

# 泰达宏利逆向策略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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 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 01 月 01 日起至 2022 年 06 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	5
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	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
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	51
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	51

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 .....	51
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 .....	51
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 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
11.1 备查文件目录 .....	56
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	泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利逆向策略混合
基金主代码	229002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 23 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	73,981,242.44 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用逆向投资策略,在有效控制投资组合风险的前提下,努力为投资者谋求资产的长期稳定增值。
投资策略	结合逆向投资核心理念和中国市场实际,本基金着重于资产配置策略和精选个股策略。在资产配置过程中,通过联邦模型寻找大类资产(股票或债券)被低估的时机,逆向投资于被低估的资产类别;在个股精选过程中,一方面利用估值和反转策略逆向精选个股,另一方面依据逆向投资理念把握事件冲击等不易量化的逆向投资机会,并辅以严格的优质公司特征分析及投资时机分析,力求获得逆向投资策略带来的长期超额收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	泰达宏利基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇娇
	联系电话	66577766
	电子邮箱	irm@mfcteda.com
客户服务电话	400-698-8888	021-60637111
传真	010-66577666	021-60635778
注册地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100026	100033
法定代表人	傅国庆	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
----------------	------

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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-27,080,322.10
本期利润	-18,394,846.61
加权平均基金份额本期利润	-0.2496
本期加权平均净值利润率	-11.11%
本期基金份额净值增长率	-9.59%
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	71,635,247.95
期末可供分配基金份额利润	0.9683
期末基金资产净值	175,119,354.51
期末基金份额净值	2.367
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	253.49%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

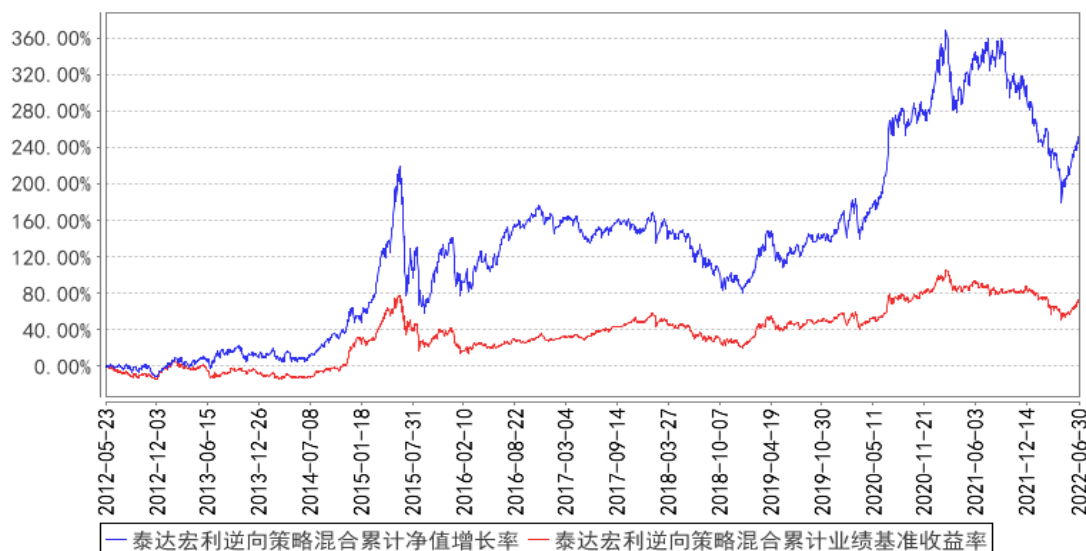
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.74%	1.13%	7.21%	0.80%	2.53%	0.33%

过去三个月	6.43%	1.61%	5.03%	1.08%	1.40%	0.53%
过去六个月	-9.59%	1.55%	-6.31%	1.09%	-3.28%	0.46%
过去一年	-20.89%	1.54%	-9.48%	0.94%	-11.41%	0.60%
过去三年	57.69%	1.45%	17.41%	0.95%	40.28%	0.50%
自基金合同生效起至今	253.49%	1.59%	72.44%	1.07%	181.05%	0.52%

注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*75%+上证国债指数收益率\*25%。沪深 300 指数由中证指数有限公司编制，指数样本选取沪深两个证券市场共 300 只股票，覆盖了大部分流通市值。成份股为市场代表性好，流动性高，交易活跃的主流投资股票，能够反映市场主流投资的收益情况，是沪深市场整体走势的最具代表性的跨市场指数，所以比较适合作为本基金权益类资产部分的比较基准。在本基金中，债券资产部分的投资主要是以降低投资组合整体风险为目的，所以在选择业绩比较基准过程中我们选择了成分券流动性较好，且风险较低的上证国债指数作为债券投资部分的业绩比较基准，该指数选取在上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

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

泰达宏利逆向策略混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金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、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、泰达宏利润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		
刘欣	总经理助理兼投资总监（权益）兼基金经理	2014 年 1 月 3 日	-	15 年	清华大学理学硕士；2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司；2011 年 7 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、投资副总监，现担任公司总经理助理兼投资总监（权益）兼基金经理；具备 15 年基金从业经验，15 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
刘洋	本基金基金经理助理	2017 年 04 月 21 日	-	7 年	北京大学理学硕士；2015 年 1 月至 2015 年 4 月就职于九坤投资（北京）有限公司，2015 年 5 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于金融工程部，先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理等职务，现担任策略投资部总经理助理兼基金经理；具备 7 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
李婷	本基金基金经理助理	2019 年 11 月 18 日	-	5 年	北京大学金融硕士，2017 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾任助理研究员，现任基金经理，具备 5 年基金从业经验，

					具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	-----------

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股市场呈现出快速下跌之后的持续反弹，市场低点出现在 4 月底。此次反弹的幅度、持续性均显著超市场预期，在反弹期间从分析师、媒体各方面舆情看，均有比较一致的观望，然而市场的反弹仍旧持续，且基本没有回调。结构上看，新能源等景气成长行业反弹力度非常强，部分个股有近翻倍的表现；消费反弹幅度适中，而低估值的金融地产等传统行业反弹相对较弱。基本面层面，上海疫情解封以及对物流压力的缓解对市场恢复信心有重大提振，外部环境上美国继续收紧货币，俄乌战争持续，没有明显改变。我们认为此阶段的市场持续反弹是对一季度快速

下跌的修复。美国市场看，上半年股债均经历了明显回调，尤其是债券市场，在加息背景下债券指数回调超过 10%，其幅度是历史罕见的。股票市场体现出较大分化，低估值传统行业股票相对抗跌，而纳斯达克代表的成长股票下跌较多。

本基金在操作中，采用量化与基本面结合的投资方法，均衡配置组合。投资风格兼顾成长确定、估值合理、景气度较高的成长性公司，和估值低、基本面稳健、存在改善预期的蓝筹股。从结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。本报告期内，本基金增加了家电、煤炭、钢铁的配置，减少了有色金属、电子、机械板块的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.367 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.59%，业绩比较基准收益率为-6.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们仍维持之前年报判断，全年仍保持中性偏乐观态度。短期看，对三季度市场表现偏中性，结构上相对均衡，但无论如何，我们认为最困难的时间已经过去。一方面国内来看，经过二季度持续快速的修复，市场估值已经相对走高，存在阶段性风险释放的压力，然而非常充裕的流动性和友好的支持政策对估值提供了一定支撑；另一方面，美国市场在偏紧的货币环境下的持续收缩，并没有对 A 股产生明显的影响，但我们认为在资金联动越来越紧密的环境下，两个市场很难持续走出完全反向的走势，未来可能趋向收敛。全年维度看，仍看好中小盘的战略投资机会和低估值股票的补涨投资机会。近年来 A 股市场在风格结构上存在年内比较强烈的极值反转特征，值得关注。反过来看，近年来各方面政策延续性较强，我们正面临长期结构转型和短期风格轧差过大的矛盾。美股方面，从情绪指标看市场有见底特征，但盈利预测仍未下调，衰退的表观预期未充分体现，尽管原材料价格已经在下跌，但是能源价格仍较高，通胀螺旋仍未结束。

基于基金合同与投资观点，我们的配置偏向于具有真实业绩成长且估值合理的股票。在交易时机上，从逆向投资角度选取情绪相对低迷的时点参与，在情绪过度亢奋期退出。本报告期内，基金在持仓上相对分散，以期平衡组合风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金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

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利逆向策略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	5,313,885.02	12,735,062.74
结算备付金		685,967.38	2,043,644.60
存出保证金		27,362.97	38,879.13
交易性金融资产	6.4.7.2	169,981,687.79	180,220,939.74
其中：股票投资		161,757,967.42	180,220,939.74
基金投资		-	-
债券投资		8,223,720.37	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		52,284.51	59,910.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,675.46
资产总计		176,061,187.67	195,101,111.86
<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		-	-
应付赎回款		119,853.05	99,632.91
应付管理人报酬		205,492.44	253,220.47
应付托管费		34,248.75	42,203.42
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	582,238.92	1,214,683.32
负债合计		941,833.16	1,609,740.12
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	73,981,242.44	73,913,383.19
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	101,138,112.07	119,577,988.55
净资产合计		175,119,354.51	193,491,371.74
负债和净资产总计		176,061,187.67	195,101,111.86

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.367 元，基金份额总额 73,981,242.44 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利逆向策略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>		-16,852,745.94	21,892,748.65
1. 利息收入		22,540.40	53,475.10
其中：存款利息收入	6.4.7.13	22,540.40	47,263.22
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		-	6,211.88
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-25,568,459.58	36,580,447.97
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-26,852,165.21	35,126,758.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	49,039.73	-
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	1,234,665.90	1,453,689.81
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	6.4.7.20	8,685,475.49	-14,768,052.99

以“-”号填列)			
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	7,697.75	26,878.57
<b>减：二、营业总支出</b>		1,542,100.67	4,163,498.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,232,341.53	1,658,850.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	205,390.25	276,475.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		251.51	-
其中：卖出回购金融资产支出		251.51	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	104,117.38	2,228,173.18
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		-18,394,846.61	17,729,250.16
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		-18,394,846.61	17,729,250.16
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-18,394,846.61	17,729,250.16

### 6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体：泰达宏利逆向策略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)	73,913,383.19	-	119,577,988.55	193,491,371.74
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)	73,913,383.19	-	119,577,988.55	193,491,371.74
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列)	67,859.25	-	-18,439,876.48	-18,372,017.23
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-18,394,846.61	-18,394,846.61
(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)	67,859.25	-	-45,029.87	22,829.38
其中:1. 基 金 申 购 款	5,627,862.19	-	7,094,167.51	12,722,029.70
2 .基 金 赎 回 款	-5,560,002.94	-	-7,139,197.38	-12,699,200.32
(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、本期期末净资产(基金净值)	73,981,242.44	-	101,138,112.07	175,119,354.51
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)	85,195,269.22	-	151,331,269.23	236,526,538.45
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)	85,195,269.22	-	151,331,269.23	236,526,538.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,367,718.72	-	7,696,741.11	2,329,022.39
(一)、综合收益总额	-	-	17,729,250.16	17,729,250.16
(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)	-5,367,718.72	-	-10,032,509.05	-15,400,227.77
其中:1.	15,725,757.69	-	29,111,183.61	44,836,941.30

基金申购款				
2. 基金赎回款	-21,093,476.41	-	-39,143,692.66	-60,237,169.07
(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)	79,827,550.50	-	159,028,010.34	238,855,560.84

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

泰达宏利逆向策略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[2011]第 1819 号《关于核准泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金募集的批复》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《泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 552,493,750.59 元,业经普华永道中天

会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 142 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 552,581,237.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 87,486.86 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 30 日公告后更名为泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为:股票资产(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)占基金资产的 60%-95%,固定收益类资产占基金资产的 0%-35%,权证占基金资产净值的 0%-3%,并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 75%+上证国债指数收益率 $\times$ 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的相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、应收利息和应收申购款，金额分别为 12,735,062.74 元、2,043,644.60 元、38,879.13 元、2,675.46 元和 59,910.19 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-应收利息和应收申购款，金额分别为 12,736,707.77 元、2,044,655.78 元、38,898.38 元、0.00 元和 59,910.19 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 180,220,939.74 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 180,220,939.74 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 99,632.91 元、253,220.47 元、42,203.42 元、1,019,980.63 元和 202.69 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、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 99,632.91 元、253,220.47 元、42,203.42 元、1,019,980.63 元和 202.69 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

本基金本报告期内无会计估计的变更。

#### 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]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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	5,313,885.02
等于：本金	5,313,335.58
加：应计利息	549.44
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	5,313,885.02

##### 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	153,886,169.12	-	161,757,967.42	7,871,798.30

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,136,990.30	73,591.87	8,223,720.37	13,138.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,136,990.30	73,591.87	8,223,720.37	13,138.20
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	162,023,159.42	73,591.87	169,981,687.79	7,884,936.50	

#### 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

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

##### 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

本基金本报告期末无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余额。

#### 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	80.87
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	483,438.50
其中：交易所市场	483,438.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,719.55
合计	582,238.92

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,913,383.19	73,913,383.19
本期申购	5,627,862.19	5,627,862.19
本期赎回（以“-”号填列）	-5,560,002.94	-5,560,002.94
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	73,981,242.44	73,981,242.44

注：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



项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	98,819,286.09	20,758,702.46	119,577,988.55
本期利润	-27,080,322.10	8,685,475.49	-18,394,846.61
本期基金份额交易产生的变动数	-103,716.04	58,686.17	-45,029.87
其中：基金申购款	6,161,660.42	932,507.09	7,094,167.51
基金赎回款	-6,265,376.46	-873,820.92	-7,139,197.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	71,635,247.95	29,502,864.12	101,138,112.07

#### 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	14,531.24
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	7,678.76
其他	330.40
合计	22,540.40

#### 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	-26,852,165.21
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	-26,852,165.21

##### 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	557,199,190.47
减：卖出股票成本总额	582,360,772.45
减：交易费用	1,690,583.23
买卖股票差价收入	-26,852,165.21

##### 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	47,311.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,728.56
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	49,039.73

##### 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	1,347,189.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,337,598.60
减：应计利息总额	7,851.86
减：交易费用	10.84
买卖债券差价收入	1,728.56

##### 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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 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	1,234,665.90
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,234,665.90

#### 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	8,685,475.49
股票投资	8,672,337.29
债券投资	13,138.20
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	8,685,475.49

#### 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	7,672.42
基金转换费收入	25.33
合计	7,697.75

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

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

#### 6.4.7.22 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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	897.83
账户维护费	9,000.00
合计	104,117.38

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(中国建设银行)	基金托管人、基金代销机构
----------------------	--------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,232,341.53	1,658,850.25
其中：支付销售机构的客户维护费	432,477.49	649,114.51

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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托管费	205,390.25	276,475.06

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国建设银行	5,313,885.02	14,531.24	20,522,162.45	38,103.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	106	5,890.42	3,183.18	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新股流通受限	52.37	47.83	115	6,022.55	5,500.45	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	147	5,862.36	4,570.23	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	34.81	16.14	276	6,405.04	4,454.64	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	70	4,417.00	2,789.50	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	120	5,616.00	6,532.80	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	13.73	15.49	633	8,691.09	9,805.17	-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股流通受限	50.31	70.37	104	5,232.24	7,318.48	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	135	5,026.05	3,427.65	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股流通受限	22.55	37.70	163	3,675.65	6,145.10	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	178	5,692.44	4,674.28	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	301	4,626.37	4,812.99	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	1,921	73,881.66	73,881.66	-

		日									
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	168	6,449.52	4,015.20		-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	303	4,738.92	6,175.14		-
301162	国能日新	2022年4月19日	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	106	4,783.78	5,735.66		-
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	20,222	77,248.04	77,248.04		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	118	4,749.50	3,609.62		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	63	4,037.04	2,363.76		-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	109	8,345.04	5,659.28		-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	91	6,614.79	6,510.14		-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	93	6,776.60	4,249.17		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	71	4,038.48	4,005.82		-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	171	5,073.57	5,690.88		-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	1,934	7,349.20	12,358.26		-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	131	4,674.08	3,909.04		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	50	4,871.44	4,391.00		-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	145	4,927.10	4,199.20		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,024	42,516.48	42,516.48		-



		日									
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	39.30	37.93	161	6,327.30	6,106.73		-
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流 通受限	72.88	31.38	177	8,599.84	5,554.26		-
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	56.69	41.86	96	5,442.24	4,018.56		-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	39.07	29.87	177	6,915.39	5,286.99		-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	8.05	10.08	773	6,222.65	7,791.84		-
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	48.30	41.68	92	4,443.60	3,834.56		-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	28.50	34.87	206	5,871.00	7,183.22		-
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	19.09	19.98	350	6,681.50	6,993.00		-
688125	安达智能	2022 年 4 月 8 日	6 个月	新股流 通受限	60.55	43.43	1,258	76,171.90	54,634.94		-
688163	赛伦生物	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	33.03	23.56	1,643	54,268.29	38,709.08		-
688173	希荻微	2022 年 1 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	33.57	31.62	1,290	43,305.30	40,789.80		-

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。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等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只偏股混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资、资产支持证券投资 and 同业存单投资资产 (2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行) 等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行

持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	5,313,885.02	-	-	-	5,313,885.02
结算备付金	685,967.38	-	-	-	685,967.38
存出保证金	27,362.97	-	-	-	27,362.97
交易性金融资产	8,223,720.37	-	-	-161,757,967.42	169,981,687.79
应收申购款	-	-	-	52,284.51	52,284.51
资产总计	14,250,935.74	-	-	-161,810,251.93	176,061,187.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	119,853.05	119,853.05
应付管理人报酬	-	-	-	205,492.44	205,492.44
应付托管费	-	-	-	34,248.75	34,248.75
其他负债	-	-	-	582,238.92	582,238.92
负债总计	-	-	-	941,833.16	941,833.16
利率敏感度缺口	14,250,935.74	-	-	-160,868,418.77	175,119,354.51
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	12,735,062.74	-	-	-	12,735,062.74
结算备付金	2,043,644.60	-	-	-	2,043,644.60
存出保证金	38,879.13	-	-	-	38,879.13
交易性金融资产	-	-	-	-180,220,939.74	180,220,939.74
应收利息	-	-	-	2,675.46	2,675.46
应收申购款	-	-	-	59,910.19	59,910.19
资产总计	14,817,586.47	-	-	-180,283,525.39	195,101,111.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	99,632.91	99,632.91
应付管理人报酬	-	-	-	253,220.47	253,220.47
应付托管费	-	-	-	42,203.42	42,203.42
应付交易费用	-	-	-	1,019,980.63	1,019,980.63
其他负债	-	-	-	194,702.69	194,702.69
负债总计	-	-	-	1,609,740.12	1,609,740.12
利率敏感度缺口	14,817,586.47	-	-	-178,673,785.27	193,491,371.74

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 4.70%(2021 年 12 月 31 日：本基金未持有交易性债券投资)，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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)占基金资产的 60%-95%，固定收益类资产占基金资产的 0%-35%，权证占基金资产净值的 0%-3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	161,757,967.42	92.37	180,220,939.74	93.14
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	161,757,967.42	92.37	180,220,939.74	93.14

#### 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%	8,300,000.00	9,590,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-8,300,000.00	-9,590,000.00

#### 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	161,247,331.62	178,507,669.83
第二层次	8,417,366.55	5,504.49

第三层次	316,989.62	1,707,765.42
合计	169,981,687.79	180,220,939.74

#### 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	161,757,967.42	91.88
	其中：股票	161,757,967.42	91.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,223,720.37	4.67
	其中：债券	8,223,720.37	4.67
	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	5,999,852.40	3.41
8	其他各项资产	79,647.48	0.05



9	合计	176,061,187.67	100.00
---	----	----------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	9,473,951.00	5.41
C	制造业	122,524,825.58	69.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,394,244.23	1.37
E	建筑业	394,815.44	0.23
F	批发和零售业	2,447,398.60	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	2,047,856.00	1.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,095,851.67	1.20
J	金融业	10,462,885.00	5.97
K	房地产业	2,746,605.00	1.57
L	租赁和商务服务业	1,728,252.23	0.99
M	科学研究和技术服务业	3,562,934.99	2.03
N	水利、环境和公共设施管理业	1,264,513.68	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	410,520.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	98,131.00	0.06
S	综合	105,183.00	0.06
	合计	161,757,967.42	92.37

### 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	300390	天华超净	78,100	6,825,940.00	3.90
2	300772	运达股份	230,700	5,869,008.00	3.35
3	002756	永兴材料	37,200	5,662,212.00	3.23
4	605117	德业股份	18,140	5,077,204.60	2.90
5	600111	北方稀土	96,050	3,377,118.00	1.93
6	600309	万华化学	29,800	2,890,302.00	1.65
7	605399	晨光新材	57,690	2,454,709.50	1.40

8	605305	中际联合	50,000	2,421,000.00	1.38
9	601225	陕西煤业	109,300	2,314,974.00	1.32
10	601318	中国平安	49,000	2,287,810.00	1.31
11	600690	海尔智家	82,000	2,251,720.00	1.29
12	300384	三联虹普	106,700	1,984,620.00	1.13
13	600036	招商银行	45,000	1,899,000.00	1.08
14	600519	贵州茅台	900	1,840,500.00	1.05
15	002867	周大生	116,000	1,801,480.00	1.03
16	601658	邮储银行	330,100	1,779,239.00	1.02
17	601888	中国中免	7,400	1,723,682.00	0.98
18	002487	大金重工	41,300	1,723,449.00	0.98
19	002508	老板电器	47,700	1,718,631.00	0.98
20	002372	伟星新材	69,800	1,677,992.00	0.96
21	300482	万孚生物	39,000	1,587,690.00	0.91
22	603259	药明康德	15,000	1,559,850.00	0.89
23	603605	珀莱雅	9,340	1,542,781.20	0.88
24	002594	比亚迪	4,300	1,434,007.00	0.82
25	002484	江海股份	61,400	1,433,076.00	0.82
26	601328	交通银行	274,700	1,368,006.00	0.78
27	002202	金风科技	88,600	1,311,280.00	0.75
28	601899	紫金矿业	140,300	1,308,999.00	0.75
29	300628	亿联网络	17,000	1,294,550.00	0.74
30	600132	重庆啤酒	8,800	1,290,080.00	0.74
31	000661	长春高新	5,500	1,283,810.00	0.73
32	000338	潍柴动力	101,100	1,260,717.00	0.72
33	000568	泸州老窖	5,100	1,257,354.00	0.72
34	600809	山西汾酒	3,800	1,234,240.00	0.70
35	000333	美的集团	20,000	1,207,800.00	0.69
36	600188	兖矿能源	29,900	1,180,452.00	0.67
37	000983	山西焦煤	85,500	1,144,845.00	0.65
38	601666	平煤股份	83,100	1,129,329.00	0.64
39	300760	迈瑞医疗	3,600	1,127,520.00	0.64
40	688556	高测股份	13,540	1,092,678.00	0.62
41	601985	中国核电	156,400	1,072,904.00	0.61
42	688233	神工股份	18,564	1,043,296.80	0.60
43	301101	明月镜片	19,800	1,016,334.00	0.58
44	601288	农业银行	332,900	1,005,358.00	0.57
45	600426	华鲁恒升	34,140	996,888.00	0.57
46	603916	苏博特	39,000	994,110.00	0.57
47	600765	中航重机	30,200	971,836.00	0.55
48	600660	福耀玻璃	22,600	944,906.00	0.54
49	002597	金禾实业	20,600	892,598.00	0.51

50	601398	工商银行	175,000	834,750.00	0.48
51	603688	石英股份	6,100	808,921.00	0.46
52	002648	卫星化学	30,282	782,789.70	0.45
53	601677	明泰铝业	32,140	764,932.00	0.44
54	002271	东方雨虹	14,800	761,756.00	0.43
55	603920	世运电路	44,000	761,200.00	0.43
56	600383	金地集团	55,900	751,296.00	0.43
57	601988	中国银行	226,100	737,086.00	0.42
58	300896	爱美客	1,200	720,012.00	0.41
59	600048	保利发展	40,800	712,368.00	0.41
60	002603	以岭药业	28,600	694,980.00	0.40
61	601686	友发集团	89,100	680,724.00	0.39
62	002918	蒙娜丽莎	35,800	670,176.00	0.38
63	600377	宁沪高速	78,000	668,460.00	0.38
64	688516	奥特维	2,500	667,375.00	0.38
65	300373	扬杰科技	9,200	655,500.00	0.37
66	002078	太阳纸业	52,900	651,199.00	0.37
67	601212	白银有色	234,200	646,392.00	0.37
68	688122	西部超导	6,900	636,180.00	0.36
69	300394	天孚通信	23,500	636,145.00	0.36
70	000002	万 科 A	30,600	627,300.00	0.36
71	002741	光华科技	31,300	623,809.00	0.36
72	300755	华致酒行	13,800	605,130.00	0.35
73	600483	福能股份	42,389	596,413.23	0.34
74	603979	金诚信	30,700	592,817.00	0.34
75	000792	盐湖股份	19,500	584,220.00	0.33
76	002669	康达新材	42,400	566,464.00	0.32
77	603588	高能环境	49,060	565,661.80	0.32
78	603012	创力集团	91,300	539,583.00	0.31
79	002832	比音勒芬	20,800	524,160.00	0.30
80	300735	光弘科技	49,900	521,455.00	0.30
81	603236	移远通信	3,900	521,274.00	0.30
82	601208	东材科技	39,800	514,216.00	0.29
83	603568	伟明环保	15,300	510,561.00	0.29
84	603713	密尔克卫	3,700	505,790.00	0.29
85	300130	新国都	40,400	495,304.00	0.28
86	002585	双星新材	27,100	490,239.00	0.28
87	603369	今世缘	9,600	489,600.00	0.28
88	600089	特变电工	17,500	479,325.00	0.27
89	603613	国联股份	5,400	478,440.00	0.27
90	601615	明阳智能	14,100	476,580.00	0.27
91	300432	富临精工	21,400	470,800.00	0.27

92	002643	万润股份	22,300	465,178.00	0.27
93	600481	双良节能	27,600	465,060.00	0.27
94	002677	浙江美大	31,700	465,039.00	0.27
95	000553	安道麦 A	38,300	463,813.00	0.26
96	603387	基蛋生物	32,280	460,312.80	0.26
97	002768	国恩股份	17,400	446,832.00	0.26
98	603833	欧派家居	2,900	436,972.00	0.25
99	002049	紫光国微	2,300	436,356.00	0.25
100	688278	特宝生物	14,418	425,042.64	0.24
101	603868	飞科电器	5,600	424,200.00	0.24
102	300803	指南针	7,100	417,338.00	0.24
103	603579	荣泰健康	16,900	416,585.00	0.24
104	603722	阿科力	8,200	413,526.00	0.24
105	300257	开山股份	27,500	411,400.00	0.23
106	300244	迪安诊断	13,200	410,520.00	0.23
107	603866	桃李面包	24,800	410,440.00	0.23
108	603816	顾家家居	7,150	404,904.50	0.23
109	688598	金博股份	1,370	403,739.00	0.23
110	603993	洛阳钼业	69,500	398,235.00	0.23
111	688711	宏微科技	5,200	396,760.00	0.23
112	000733	振华科技	2,900	394,313.00	0.23
113	300475	香农芯创	19,500	392,925.00	0.22
114	688198	佰仁医疗	3,200	390,144.00	0.22
115	603303	得邦照明	25,300	389,873.00	0.22
116	600486	扬农化工	2,900	386,512.00	0.22
117	300607	拓斯达	29,000	383,380.00	0.22
118	300595	欧普康视	6,700	383,173.00	0.22
119	002968	新大正	15,400	379,764.00	0.22
120	603515	欧普照明	21,600	376,920.00	0.22
121	300445	康斯特	32,700	374,742.00	0.21
122	600873	梅花生物	32,900	371,112.00	0.21
123	603195	公牛集团	2,400	366,984.00	0.21
124	000039	中集集团	26,200	362,870.00	0.21
125	300327	中颖电子	7,140	355,643.40	0.20
126	002539	云图控股	22,000	351,780.00	0.20
127	002601	龙佰集团	17,300	346,865.00	0.20
128	603378	亚士创能	29,675	346,010.50	0.20
129	603611	诺力股份	19,700	342,386.00	0.20
130	002555	三七互娱	16,100	341,803.00	0.20
131	603128	华贸物流	33,700	338,011.00	0.19
132	603337	杰克股份	15,700	337,236.00	0.19
133	300769	德方纳米	820	335,117.60	0.19

134	600256	广汇能源	31,500	332,010.00	0.19
135	002649	博彦科技	31,500	321,615.00	0.18
136	600546	山煤国际	16,500	321,090.00	0.18
137	603719	良品铺子	11,200	320,656.00	0.18
138	601898	中煤能源	30,400	315,552.00	0.18
139	600096	云天化	10,000	314,800.00	0.18
140	300726	宏达电子	5,100	311,967.00	0.18
141	002216	三全食品	15,800	309,522.00	0.18
142	603867	新化股份	9,100	309,127.00	0.18
143	300740	水羊股份	22,300	306,402.00	0.17
144	603818	曲美家居	32,000	304,000.00	0.17
145	002841	视源股份	4,000	301,280.00	0.17
146	603728	鸣志电器	13,300	282,359.00	0.16
147	000708	中信特钢	14,000	282,100.00	0.16
148	600392	盛和资源	12,400	280,240.00	0.16
149	600233	圆通速递	13,700	279,343.00	0.16
150	603379	三美股份	12,400	275,900.00	0.16
151	600639	浦东金桥	20,300	275,877.00	0.16
152	603968	醋化股份	13,000	267,800.00	0.15
153	600389	江山股份	4,400	267,212.00	0.15
154	600989	宝丰能源	18,200	266,630.00	0.15
155	002472	双环传动	8,200	261,088.00	0.15
156	601231	环旭电子	18,100	259,916.00	0.15
157	688303	大全能源	3,700	252,784.00	0.14
158	002812	恩捷股份	1,000	250,450.00	0.14
159	000968	蓝焰控股	22,900	239,305.00	0.14
160	605499	东鹏饮料	1,400	239,204.00	0.14
161	002466	天齐锂业	1,900	237,120.00	0.14
162	002615	哈尔斯	37,200	231,384.00	0.13
163	002920	德赛西威	1,500	222,000.00	0.13
164	300481	濮阳惠成	9,400	220,900.00	0.13
165	002911	佛燃能源	24,200	219,736.00	0.13
166	603886	元祖股份	12,300	216,726.00	0.12
167	601138	工业富联	21,800	214,512.00	0.12
168	300398	飞凯材料	9,300	212,598.00	0.12
169	603156	养元饮品	9,300	211,296.00	0.12
170	000786	北新建材	6,100	211,182.00	0.12
171	000729	燕京啤酒	21,500	207,690.00	0.12
172	002128	电投能源	14,200	203,344.00	0.12
173	603681	永冠新材	8,100	199,098.00	0.11
174	300855	图南股份	4,750	198,502.50	0.11
175	002407	多氟多	4,000	195,640.00	0.11

176	603908	牧高笛	2,000	190,300.00	0.11
177	600348	华阳股份	12,200	188,612.00	0.11
178	603208	江山欧派	2,600	187,798.00	0.11
179	603601	再升科技	29,500	187,620.00	0.11
180	300604	长川科技	4,100	185,115.00	0.11
181	688567	孚能科技	6,500	184,665.00	0.11
182	603887	城地香江	23,600	184,316.00	0.11
183	300184	力源信息	33,500	184,250.00	0.11
184	002497	雅化集团	5,600	182,840.00	0.10
185	600160	巨化股份	13,900	182,785.00	0.10
186	002312	川发龙蟒	10,500	181,230.00	0.10
187	002984	森麒麟	5,800	180,438.00	0.10
188	002381	双箭股份	28,100	180,402.00	0.10
189	688396	华润微	3,000	177,210.00	0.10
190	600141	兴发集团	4,000	175,960.00	0.10
191	002810	山东赫达	4,800	174,672.00	0.10
192	300477	合纵科技	22,400	172,480.00	0.10
193	002738	中矿资源	1,840	170,402.40	0.10
194	002833	弘亚数控	9,940	165,799.20	0.09
195	002304	洋河股份	900	164,835.00	0.09
196	600929	雪天盐业	17,600	163,328.00	0.09
197	603708	家家悦	11,200	159,488.00	0.09
198	600612	老凤祥	3,800	158,764.00	0.09
199	300363	博腾股份	2,000	155,980.00	0.09
200	300766	每日互动	13,400	155,976.00	0.09
201	600863	内蒙华电	42,500	155,125.00	0.09
202	600499	科达制造	7,500	154,800.00	0.09
203	300222	科大智能	19,200	154,752.00	0.09
204	300285	国瓷材料	4,300	154,456.00	0.09
205	002534	西子洁能	9,400	153,126.00	0.09
206	300634	彩讯股份	12,000	152,400.00	0.09
207	002043	兔宝宝	13,100	151,960.00	0.09
208	601156	东航物流	7,600	150,480.00	0.09
209	000683	远兴能源	14,300	150,293.00	0.09
210	000893	亚钾国际	4,300	147,963.00	0.08
211	300472	新元科技	13,500	145,125.00	0.08
212	601668	中国建筑	26,800	142,576.00	0.08
213	002035	华帝股份	24,400	142,008.00	0.08
214	002171	楚江新材	15,200	141,816.00	0.08
215	000858	五粮液	700	141,351.00	0.08
216	600905	三峡能源	22,400	140,896.00	0.08
217	002203	海亮股份	12,100	139,755.00	0.08

218	601369	陕鼓动力	14,100	135,360.00	0.08
219	601838	成都银行	8,100	134,298.00	0.08
220	002522	浙江众成	23,400	132,912.00	0.08
221	002416	爱施德	13,900	129,270.00	0.07
222	002182	云海金属	5,100	127,908.00	0.07
223	601567	三星医疗	9,600	127,488.00	0.07
224	603766	隆鑫通用	27,500	126,775.00	0.07
225	001696	宗申动力	19,900	125,967.00	0.07
226	600429	三元股份	24,000	125,760.00	0.07
227	603619	中曼石油	6,100	125,477.00	0.07
228	000596	古井贡酒	500	124,830.00	0.07
229	600761	安徽合力	10,400	123,760.00	0.07
230	002960	青鸟消防	4,500	123,255.00	0.07
231	600882	妙可蓝多	2,600	121,680.00	0.07
232	600987	航民股份	22,600	120,458.00	0.07
233	000848	承德露露	12,400	120,032.00	0.07
234	002298	中电兴发	18,200	119,392.00	0.07
235	000062	深圳华强	9,400	119,380.00	0.07
236	300146	汤臣倍健	5,500	119,075.00	0.07
237	600846	同济科技	15,000	118,500.00	0.07
238	002009	天奇股份	6,400	118,400.00	0.07
239	002228	合兴包装	32,700	118,374.00	0.07
240	000969	安泰科技	13,100	116,852.00	0.07
241	600887	伊利股份	3,000	116,850.00	0.07
242	002293	罗莱生活	8,800	115,896.00	0.07
243	000032	深桑达 A	7,700	115,346.00	0.07
244	300685	艾德生物	3,600	115,200.00	0.07
245	002672	东江环保	18,600	115,134.00	0.07
246	300316	晶盛机电	1,700	114,903.00	0.07
247	000544	中原环保	19,700	113,866.00	0.07
248	603609	禾丰股份	11,400	109,782.00	0.06
249	600655	豫园股份	11,600	109,504.00	0.06
250	000877	天山股份	8,900	109,470.00	0.06
251	002698	博实股份	9,200	108,836.00	0.06
252	603551	奥普家居	11,700	108,459.00	0.06
253	603587	地素时尚	6,800	107,780.00	0.06
254	601882	海天精工	5,200	107,172.00	0.06
255	600482	中国动力	6,800	106,828.00	0.06
256	300750	宁德时代	200	106,800.00	0.06
257	002675	东诚药业	7,900	106,650.00	0.06
258	002120	韵达股份	6,200	105,772.00	0.06
259	603883	老百姓	3,120	105,705.60	0.06

260	002901	大博医疗	2,700	105,678.00	0.06
261	600580	卧龙电驱	7,300	105,266.00	0.06
262	600673	东阳光	11,700	105,183.00	0.06
263	300525	博思软件	4,900	105,105.00	0.06
264	688006	杭可科技	1,500	105,090.00	0.06
265	002792	通宇通讯	8,700	104,922.00	0.06
266	002595	豪迈科技	4,600	102,764.00	0.06
267	601330	绿色动力	13,100	102,573.00	0.06
268	600060	海信视像	8,200	102,500.00	0.06
269	600261	阳光照明	30,300	102,111.00	0.06
270	000030	富奥股份	18,600	101,928.00	0.06
271	002946	新乳业	7,600	98,724.00	0.06
272	601900	南方传媒	12,100	98,131.00	0.06
273	600458	时代新材	10,000	98,000.00	0.06
274	000878	云南铜业	8,600	97,954.00	0.06
275	603489	八方股份	500	97,245.00	0.06
276	000060	中金岭南	21,800	97,228.00	0.06
277	601728	中国电信	25,800	96,234.00	0.05
278	600459	贵研铂业	5,300	95,983.00	0.05
279	603707	健友股份	3,400	95,880.00	0.05
280	603386	骏亚科技	6,100	95,709.00	0.05
281	600917	重庆燃气	13,200	95,304.00	0.05
282	300138	晨光生物	6,100	94,977.00	0.05
283	300529	健帆生物	1,800	91,602.00	0.05
284	603013	亚普股份	6,100	85,217.00	0.05
285	688798	艾为电子	600	81,528.00	0.05
286	605008	长鸿高科	5,800	81,316.00	0.05
287	605166	聚合顺	6,200	79,112.00	0.05
288	603928	兴业股份	6,000	78,780.00	0.04
289	301175	中科环保	20,222	77,248.04	0.04
290	300684	中石科技	5,500	76,725.00	0.04
291	301139	元道通信	1,921	73,881.66	0.04
292	688690	纳微科技	900	72,729.00	0.04
293	600585	海螺水泥	2,000	70,560.00	0.04
294	688295	中复神鹰	1,800	67,482.00	0.04
295	688125	安达智能	1,258	54,634.94	0.03
296	301233	盛帮股份	1,024	42,516.48	0.02
297	688173	希荻微	1,290	40,789.80	0.02
298	000898	鞍钢股份	12,100	38,962.00	0.02
299	688163	赛伦生物	1,643	38,709.08	0.02
300	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
301	301219	腾远钴业	230	21,037.40	0.01



302	603176	汇通集团	1,924	18,393.44	0.01
303	301215	中汽股份	1,934	12,358.26	0.01
304	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
305	301120	新特电气	633	9,805.17	0.01
306	301206	三元生物	175	8,138.43	0.00
307	301256	华融化学	773	7,791.84	0.00
308	301122	采纳股份	104	7,318.48	0.00
309	301268	铭利达	206	7,183.22	0.00
310	301288	清研环境	350	6,993.00	0.00
311	301117	佳缘科技	120	6,532.80	0.00
312	301201	诚达药业	91	6,510.14	0.00
313	301158	德石股份	303	6,175.14	0.00
314	301130	西点药业	163	6,145.10	0.00
315	301235	华康医疗	161	6,106.73	0.00
316	301162	国能日新	106	5,735.66	0.00
317	301212	联盛化学	171	5,690.88	0.00
318	301200	大族数控	109	5,659.28	0.00
319	301236	软通动力	177	5,554.26	0.00
320	301097	天益医疗	115	5,500.45	0.00
321	301248	杰创智能	177	5,286.99	0.00
322	301137	哈焊华通	301	4,812.99	0.00
323	301135	瑞德智能	178	4,674.28	0.00
324	301102	兆讯传媒	147	4,570.23	0.00
325	301109	军信股份	276	4,454.64	0.00
326	301222	浙江恒威	145	4,199.20	0.00
327	301237	和顺科技	96	4,018.56	0.00
328	301148	嘉戎技术	168	4,015.20	0.00
329	301207	华兰疫苗	71	4,005.82	0.00
330	301216	万凯新材	131	3,909.04	0.00
331	301258	富士莱	92	3,834.56	0.00
332	301181	标榜股份	118	3,609.62	0.00
333	301123	奕东电子	135	3,427.65	0.00
334	301189	奥尼电子	102	3,397.62	0.00
335	300834	星辉环材	106	3,183.18	0.00
336	301110	青木股份	70	2,789.50	0.00
337	301196	唯科科技	63	2,363.76	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	600111	北方稀土	7,935,023.50	4.10

2	300772	运达股份	7,928,546.20	4.10
3	002466	天齐锂业	7,845,026.00	4.05
4	603799	华友钴业	6,471,935.00	3.34
5	300390	天华超净	6,154,148.00	3.18
6	002756	永兴材料	5,964,496.00	3.08
7	601985	中国核电	4,540,221.00	2.35
8	605117	德业股份	4,477,781.60	2.31
9	605399	晨光新材	4,130,864.00	2.13
10	002487	大金重工	4,064,777.98	2.10
11	601166	兴业银行	3,774,476.00	1.95
12	002648	卫星化学	3,702,847.60	1.91
13	600309	万华化学	3,528,619.00	1.82
14	603596	伯特利	3,408,992.00	1.76
15	600456	宝钛股份	3,337,635.00	1.72
16	300726	宏达电子	3,171,817.93	1.64
17	600483	福能股份	3,160,092.00	1.63
18	605305	中际联合	3,108,591.52	1.61
19	002484	江海股份	2,953,045.00	1.53
20	002867	周大生	2,781,235.43	1.44

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	002466	天齐锂业	14,346,843.48	7.41
2	603799	华友钴业	13,402,602.00	6.93
3	600111	北方稀土	6,337,121.00	3.28
4	601985	中国核电	4,820,780.00	2.49
5	300772	运达股份	4,410,113.00	2.28
6	300124	汇川技术	4,216,757.70	2.18
7	605117	德业股份	3,908,833.36	2.02
8	600483	福能股份	3,724,860.00	1.93
9	601166	兴业银行	3,711,326.52	1.92
10	002597	金禾实业	3,669,525.00	1.90
11	002049	紫光国微	3,629,891.00	1.88
12	300726	宏达电子	3,499,732.00	1.81
13	300982	苏文电能	3,471,316.94	1.79
14	603688	石英股份	3,454,073.28	1.79
15	002594	比亚迪	3,442,592.00	1.78
16	603596	伯特利	3,392,376.00	1.75

17	600456	宝钛股份	3,155,963.00	1.63
18	300390	天华超净	3,139,992.00	1.62
19	300450	先导智能	3,123,697.00	1.61
20	688598	金博股份	2,968,489.46	1.53

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。

#### 7.4.3 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	555,225,462.84
卖出股票收入（成交）总额	557,199,190.47

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	8,223,720.37	4.70
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	8,223,720.37	4.70

#### 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	019666	22 国债 01	72,390	7,320,245.38	4.18
2	019674	22 国债 09	9,000	903,474.99	0.52

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。

#### 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

本基金股指期货投资将以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行操作。具体股指期货投资策略包括：(a) 对冲投资组合的系统性风险；(b) 有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,362.97
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	52,284.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,647.48

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
35,441	2,087.45	6,970,759.03	9.42	67,010,483.41	90.58

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	470,484.31	0.6360

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2012 年 5 月 23 日) 基金份额总额	552,581,237.45
本报告期期初基金份额总额	73,913,383.19
本报告期基金总申购份额	5,627,862.19
减：本报告期基金总赎回份额	5,560,002.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	73,981,242.44

## § 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的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期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、本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
广发证券	1	304,068,593.55	27.43	283,171.07	27.42	-
浙商证券	1	288,888,397.10	26.06	269,045.64	26.06	-
银河证券	2	142,139,728.64	12.82	132,377.79	12.82	-
国信证券	1	67,382,798.29	6.08	62,753.52	6.08	-
中信证券	3	67,010,474.83	6.04	62,407.65	6.04	-
海通证券	1	65,729,573.71	5.93	61,215.14	5.93	-
中信建投	1	60,199,657.64	5.43	56,065.17	5.43	-
华创证券	1	44,273,600.78	3.99	41,231.69	3.99	-
中泰证券	2	42,072,192.8	3.79	39,183.13	3.79	-

		5				
德邦证券	1	26,954,814.47	2.43	25,102.35	2.43	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期交易单元无变更。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券	10,240,353.90	94.70	800,000.00	100.00	-	-

浙商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	573,573.00	5.30	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

## § 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