

泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF） 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人及基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49

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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	泰达宏利 500 指数增强 (LOF)
基金主代码	162216
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 6 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	266,870,659.68 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对中证 500 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，在控制与比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times 1 \text{ 年期定期存款利率 (税后)}$
风险收益特征	本基金为股票型指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇娇	许俊
	联系电话	66577766	010-66594319
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-698-8888	95566
传真		010-66577666	010-66594942
注册地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100026	100818
法定代表人		刘轶	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	47,539,001.32
本期利润	53,802,223.26
加权平均基金份额本期利润	0.1955
本期加权平均净值利润率	13.69%
本期基金份额净值增长率	14.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	296,141,020.82
期末可供分配基金份额利润	1.1097
期末基金资产净值	413,004,936.97
期末基金份额净值	1.5476
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	63.44%

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

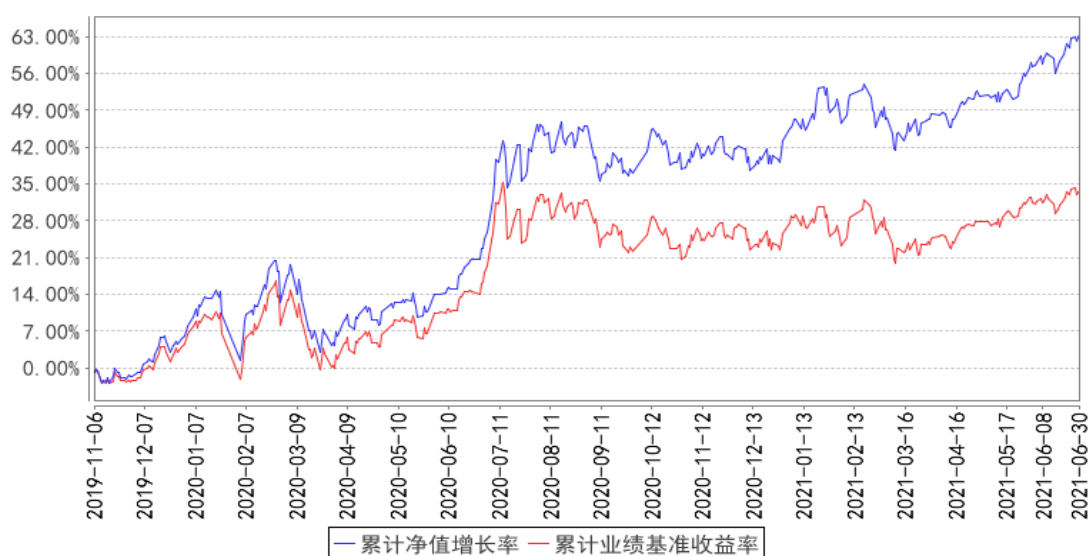
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	4.09%	0.76%	1.13%	0.69%	2.96%	0.07%
过去三个月	10.95%	0.70%	8.43%	0.65%	2.52%	0.05%
过去六个月	14.06%	0.95%	6.64%	0.94%	7.42%	0.01%
过去一年	33.29%	1.19%	15.42%	1.19%	17.87%	0.00%
自基金合同生效起至今	63.44%	1.32%	33.86%	1.33%	29.58%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率*95%+1 年期定期存款利率(税后)*5%。

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500指数增强（LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告

期末本公司股东及持股比例分别为：天津市泰达国际控股（集团）有限公司：51%；宏利投资管理（香港）有限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利永利债券型证券投资基金、泰达宏利品牌升级混合型证券投资基金、泰达宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利价值长青混合型证券投资基金、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金、泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利消费服务混合型证券投资基金、泰达宏利新能源股票型证券投资基金、泰达宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘洋	策略投资部总经理助理；基金经理	2019 年 11 月 6 日	-	6 年	北京大学理学硕士；2015 年 1 月至 2015 年 4 月就职于九坤投资（北京）有限公司，2015 年 5 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于金融工程部，先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理等职务，现担任策略投资部总经理助理兼基金经理；具备 6 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
刘欣	总经理助理兼投资总监（权益）兼基金经理	2019 年 11 月 20 日	-	14 年	清华大学理学硕士；2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司；2011 年 7 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、投资副总监，现担任公司总经理助理兼投资总监（权益）兼基金经理；具备 14 年基金从业经验，14 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
李 婷	基金经理助理	2019 年 11 月 6 日	-	4 年	北京大学金融硕士，2017 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾任助理研究员，现任基金经理助理，具备 4 年基金从业经验，具有基金从业资格。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，未发现明显的非公平交易指令；

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%，在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年 A 股市场历经数次风格切换，结构性行情特点依旧。春节前绩优白马股延续了 2020 年以来的盈利质量占优的风格且逐渐演绎至相当极致的水平；节后高质量与高成长风格迅速回调，价值风格得到一定程度的修复并成为资金避险之选；二季度市场结构性行情再现，随着疫苗接种与经济修复进程的推进，且国内外流动性环境超预期宽松，市场主导风格从蓝筹的高盈利质量切换为阶段性高景气与盈利改善风格。具体表现为受益于制造业生产需求修复、大宗商品涨价或因碳排放政策限制供应端产能的钢铁、煤炭、有色等上游资源型行业，以及景气度大幅改善且业绩得到逐步验证的新能源、汽车、化工、光伏等制造行业在二季度脱颖而出，成为市场新的选择方向。以半导体、军工为代表的高端制造领域在历经前期宽幅震荡后亦得到了市场的认可。

本基金在操作中恪守基金合同，采用指数增强策略，严格控制跟踪误差及其他风险属性。使用量化选股手段，挑选盈利质量高、盈利增速稳定、估值合理的中盘绩优股票。选股风格偏向长期基本面，较好的控制了持仓换手率与交易成本。持仓结构分散以控制个股风险，仓位保持合理稳定。本报告期内，本基金增加了电子、计算机、有色金属行业的配置，减少了医药、非银行金融、电力设备及新能源行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.5476 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.06%，业绩比较基准收益率为 6.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，国内与世界范围内生产与消费的修复进程仍将持续，疫情控制变数造成的经济回暖节奏或不达预期，各国对通胀的容忍程度也将更高，从而继续维持一个有利于资本市场的偏宽松的流动性环境。从经济基本面来看，下半年国内消费增速回暖趋势依旧，投资端制造业的新能源、汽车、芯片等领域持续大规模资本开支，地方专项债加快发行或使基建投资保持增长，且当前出口数据仍然强劲，对于企业盈利端有较好的支撑。市场风格偏好方面，因经济增长中枢长期下行，成长性逐渐成为稀缺资源，而中性偏松的货币政策基调也更加有利于成长风格。另一方面，前期大部分机构资金配置集中于绩优蓝筹领域，后期不排除仍有相当体量的资金迫于压力进行风格调整，从而进一步维持新能源、半导体、有色、化工等热门赛道的强势局面。中长期看我们倾向于市场风格将回归均衡，前期跌幅较大的高盈利质量与低估值风格在未来仍然值得重视。

基于基金合同与投资观点，本基金在选股策略上倾向于选择盈利质量高、公司治理规范、估值合理、有长期业绩成长能力的股票。在严格控制行业与风格暴露风险的前提下力争获取稳定的选股超额收益。在持仓上选择不过分暴露个股相对权重，以期分散投资以平衡组合风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况,本基金本报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2021 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	21,571,066.72	6,108,498.98
结算备付金		2,700,873.04	1,735,438.30

存出保证金		40,821.73	71,416.11
交易性金融资产	6.4.7.2	388,942,612.90	383,066,173.94
其中：股票投资		388,942,612.90	367,336,693.94
基金投资		-	-
债券投资		-	15,729,480.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,759,741.90	2,994,041.90
应收利息	6.4.7.5	3,154.00	193,675.85
应收股利		-	-
应收申购款		837,350.20	521,361.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		418,855,620.49	394,690,606.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,856,890.75	1,751,866.23
应付赎回款		1,771,928.06	946,801.22
应付管理人报酬		333,409.76	325,855.91
应付托管费		66,681.95	65,171.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,637,366.44	904,550.03
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	184,406.56	263,033.09
负债合计		5,850,683.52	4,257,277.64
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	112,795,836.18	121,627,215.24
未分配利润	6.4.7.10	300,209,100.79	268,806,114.10
所有者权益合计		413,004,936.97	390,433,329.34
负债和所有者权益总计		418,855,620.49	394,690,606.98

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5476 元，基金份额总额 266,870,659.68 份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		60,536,618.14	53,283,606.74
1. 利息收入		141,207.61	215,632.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,812.54	46,343.67
债券利息收入		95,395.07	169,289.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		53,993,228.79	43,479,387.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	50,758,763.72	40,475,082.52
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,240.00	-88,604.51
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,228,225.07	3,092,909.84
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,263,221.94	9,365,604.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	138,959.80	222,981.43
减：二、费用		6,734,394.88	5,553,497.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,949,698.61	1,702,952.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	389,939.71	340,590.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,149,747.96	3,260,009.06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	245,008.60	249,945.07

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		53,802,223.26	47,730,109.42
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		53,802,223.26	47,730,109.42

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	121,627,215.24	268,806,114.10	390,433,329.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	53,802,223.26	53,802,223.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-8,831,379.06	-22,399,236.57	-31,230,615.63
其中: 1. 基金申购款	30,278,399.40	71,715,004.22	101,993,403.62
2. 基金赎回款	-39,109,778.46	-94,114,240.79	-133,224,019.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	112,795,836.18	300,209,100.79	413,004,936.97
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	110,825,421.75	152,718,519.24	263,543,940.99
二、本期经营活	-	47,730,109.42	47,730,109.42

动产生的基金净值变动数 (本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	25,820,819.50	38,285,035.36	64,105,854.86
其中: 1. 基金申购款	95,871,050.60	142,970,922.27	238,841,972.87
2. 基金赎回款	-70,050,231.10	-104,685,886.91	-174,736,118.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	136,646,241.25	238,733,664.02	375,379,905.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

傅国庆

傅国庆

王泉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)由泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金 (以下简称“泰达宏利中证 500 指数分级基金”)转型而来。根据基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2019 年 10 月 29 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金实施转型的公告》,原泰达宏利中证 500 指数分级基金以现场方式召开了基金份额持有人大会。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,基金管理人根据基金份额持有人大会的授权,定于 2019 年 11 月 6 日正式实施基金转型。《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》自 2019 年 11 月 6 日起生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司 (以下简称“中国银行”)。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”)深证上[2019]776 号核准,本基金 5,381,032.00 份

基金份额于 2019 年 12 月 5 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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)、债券 (包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转换债券等)、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具、同业存单及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 80%, 投资组合中投资于中证 500 指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。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, 基金保留的现金或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%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。本基金的业绩比较基准为: $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times 1 \text{ 年期定期存款利率 (税后)}$ 。

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》、《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	21,571,066.72
定期存款	—
其中: 存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计	21,571,066.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	368,770,721.83	388,942,612.90	20,171,891.07
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	368,770,721.83	388,942,612.90	20,171,891.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,043.86
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	1,090.26
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.08
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	19.80
合计	3,154.00

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,637,366.44
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,637,366.44

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	6,007.31
应付证券出借违约金	—
预提费用	128,399.25
指数使用费	50,000.00
合计	184,406.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	287,765,245.64	121,627,215.24
本期申购	71,637,543.37	30,278,399.40
本期赎回 (以“-”号填列)	-92,532,129.33	-39,109,778.46
- 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	266,870,659.68	112,795,836.18

注：1. 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。

2. 截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 3,054,378.00 份 (2020 年 12 月 31 日：3,372,598.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 263,816,281.68 份 (2020 年 12 月 31 日：284,392,647.64 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	268,883,476.10	-77,362.00	268,806,114.10
本期利润	47,539,001.32	6,263,221.94	53,802,223.26
本期基金份额交易产生的变动数	-20,281,456.60	-2,117,779.97	-22,399,236.57
其中：基金申购款	72,991,418.76	-1,276,414.54	71,715,004.22
基金赎回款	-93,272,875.36	-841,365.43	-94,114,240.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	296,141,020.82	4,068,079.97	300,209,100.79

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,128.94
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	15,442.26
其他	1,241.34
合计	45,812.54

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	50,758,763.72
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	50,758,763.72

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,373,262,695.81
减：卖出股票成本总额	1,322,503,932.09
买卖股票差价收入	50,758,763.72

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期末有股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	6,240.00
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	6,240.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,975,083.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	15,681,120.00
减：应收利息总额	287,723.84
买卖债券差价收入	6,240.00

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,228,225.07
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	3,228,225.07

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,263,221.94
股票投资	6,311,581.94
债券投资	-48,360.00
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	6,263,221.94

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	138,959.80
合计	138,959.80

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

交易所市场交易费用	4,149,747.96
银行间市场交易费用	—
合计	4,149,747.96

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	7,609.35
账户维护费	13,426.92
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
合计	245,008.60

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、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,949,698.61	1,702,952.70
其中：支付销售机构的客户维护费	446,293.12	393,070.20

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 1.0%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 X1.0%/当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	389,939.71	340,590.49

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%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 X0.2%/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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	21,571,066.72	29,128.94	14,971,663.22	29,500.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年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(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688696	极米科技	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 3 日	新股流通受限	133.73	780.24	680	90,936.40	530,563.20	-
688083	中望软件	2021 年 3 月 4 日	2021 年 9 月 13 日	新股流通受限	150.50	524.08	638	96,019.00	334,363.04	-
688538	和辉光电	2021 年 5 月 20 日	2021 年 11 月 29 日	新股流通受限	2.65	3.38	87,336	231,440.40	295,195.68	-
688656	浩欧博	2021 年 1 月 6 日	2021 年 7 月 13 日	新股流通受限	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60	-
688201	信安世纪	2021 年 4 月 13 日	2021 年 10 月 21 日	新股流通受限	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89	-
688621	阳光诺和	2021 年 6 月 11 日	2021 年 12 月 21 日	新股流通受限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688316	青云科技	2021 年 3 月 5 日	2021 年 9 月 16 日	新股流通受限	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 1 日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688070	纵横股份	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	-
688662	富信科技	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	新股流通受限	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股流通受限	24.60	163.00	433	10,651.80	70,579.00	-
688355	明志科技	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 12 日	新股流通受限	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-

300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股流 通受限	47.33	251.96	217	10,270.61	54,675.32	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688685	迈信林	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 15 日	新股流 通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股未 上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688659	元琛科技	2021 年 3 月 24 日	2021 年 10 月 8 日	新股流 通受限	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-
688092	爱科科技	2021 年 3 月 12 日	2021 年 9 月 22 日	新股流 通受限	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股流 通受限	28.28	115.71	297	8,399.16	34,365.87	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流 通受限	33.22	87.50	379	12,590.38	33,162.50	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流 通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流 通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流 通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15	2021 年 7 月 22	新股流 通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-

		日	日							
300982	苏文 电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流 通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股流 通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极 光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股流 通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川 畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流 通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易 购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股流 通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和 兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流 通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞 生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流 通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐 家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流 通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰 股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流 通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛 股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流 通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才 股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨 家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力 股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股流 通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉	2021 年	2021 年	新股流	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-

	安防	3 月 3 日	9 月 13 日	通受限						
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 07 月 12 日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-

301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股流 通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流 通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流 通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流 通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流 通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股流 通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 07 月 21 日	新股流 通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股流 通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流 通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流 通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流 通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25	2021 年 12 月 2	新股流 通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

		日	日							
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股流 通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流 通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股流 通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流 通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金为股票型指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、资产支

持证券和同业存单投资 (2020 年 12 月 31 日: 同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 6 月 30 日, 除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息 (该利息金额不重大) 外, 本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值 (所有者权益) 无固定到期日且不计息, 因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,571,066.72	-	-	-	21,571,066.72
结算备付金	2,700,873.04	-	-	-	2,700,873.04
存出保证金	40,821.73	-	-	-	40,821.73
交易性金融资产	-	-	-	-388,942,612.90	388,942,612.90

应收利息	-	-	-	3,154.00	3,154.00
应收申购款	994.04	-	-	836,356.16	837,350.20
应收证券清算款	-	-	-	4,759,741.90	4,759,741.90
资产总计	24,313,755.53	-	-	394,541,864.96	418,855,620.49
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,771,928.06	1,771,928.06
应付管理人报酬	-	-	-	333,409.76	333,409.76
应付托管费	-	-	-	66,681.95	66,681.95
应付证券清算款	-	-	-	1,856,890.75	1,856,890.75
应付交易费用	-	-	-	1,637,366.44	1,637,366.44
其他负债	-	-	-	184,406.56	184,406.56
负债总计	-	-	-	5,850,683.52	5,850,683.52
利率敏感度缺口	24,313,755.53	-	-	388,691,181.44	413,004,936.97
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	6,108,498.98	-	-	-	6,108,498.98
结算备付金	1,735,438.30	-	-	-	1,735,438.30
存出保证金	71,416.11	-	-	-	71,416.11
交易性金融资产	15,729,480.00	-	-	367,336,693.94	383,066,173.94
应收利息	-	-	-	193,675.85	193,675.85
应收申购款	-	-	-	521,361.90	521,361.90
应收证券清算款	-	-	-	2,994,041.90	2,994,041.90
资产总计	23,644,833.39	-	-	371,045,773.59	394,690,606.98
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	946,801.22	946,801.22
应付管理人报酬	-	-	-	325,855.91	325,855.91
应付托管费	-	-	-	65,171.16	65,171.16
应付证券清算款	-	-	-	1,751,866.23	1,751,866.23
应付交易费用	-	-	-	904,550.03	904,550.03
其他负债	-	-	-	263,033.09	263,033.09
负债总计	-	-	-	4,257,277.64	4,257,277.64
利率敏感度缺口	23,644,833.39	-	-	366,788,495.95	390,433,329.34

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资 (2020 年 12 月 31 日：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 4.03%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	388,942,612.90	94.17	367,336,693.94	94.08
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	388,942,612.90	94.17	367,336,693.94	94.08

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	12,180,000.00	18,780,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-12,180,000.00	-18,780,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	388,942,612.90	92.86
	其中：股票	388,942,612.90	92.86
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	24,271,939.76	5.79
8	其他各项资产	5,641,067.83	1.35
9	合计	418,855,620.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	856,605.90	0.21
B	采矿业	7,898,607.00	1.91
C	制造业	201,108,009.08	48.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,391,904.00	1.55
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,145,786.00	4.88
G	交通运输、仓储和邮政业	11,073,426.00	2.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,935,226.60	7.25
J	金融业	13,480,803.60	3.26
K	房地产业	10,793,094.00	2.61
L	租赁和商务服务业	2,128,529.15	0.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,520,245.40	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,258,590.00	1.27
R	文化、体育和娱乐业	3,175,146.00	0.77
S	综合	-	-
	合计	315,765,972.73	76.46

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	778,220.28	0.19
B	采矿业	2,481,971.00	0.60
C	制造业	42,732,237.70	10.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	3,967,947.37	0.96
F	批发和零售业	89,166.82	0.02
G	交通运输、仓储和	-	-

	邮政业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,155,450.00	2.22
J	金融业	6,283,766.10	1.52
K	房地产业	4,472,532.00	1.08
L	租赁和商务服务业	753,328.50	0.18
M	科学研究和技术服务业	95,025.15	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	2,362,333.25	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	73,176,640.17	17.72

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	000830	鲁西化工	388,100	7,269,113.00	1.76
2	603486	科沃斯	31,700	7,230,136.00	1.75
3	000799	酒鬼酒	27,000	6,901,200.00	1.67
4	300699	光威复材	82,800	6,288,660.00	1.52
5	600884	杉杉股份	258,600	6,030,552.00	1.46
6	600885	宏发股份	95,440	5,984,088.00	1.45
7	603444	吉比特	11,100	5,883,000.00	1.42
8	000630	铜陵有色	1,996,700	5,431,024.00	1.32
9	300146	汤臣倍健	161,022	5,297,623.80	1.28
10	300244	迪安诊断	137,300	5,258,590.00	1.27
11	002180	纳思达	163,000	5,248,600.00	1.27
12	300168	万达信息	358,000	5,226,800.00	1.27
13	688099	晶晨股份	45,828	5,141,901.60	1.24
14	002048	宁波华翔	262,800	5,124,600.00	1.24
15	300463	迈克生物	121,400	5,109,726.00	1.24

16	000825	太钢不锈	680,900	5,099,941.00	1.23
17	000012	南玻A	496,900	5,088,256.00	1.23
18	300474	景嘉微	50,900	4,984,128.00	1.21
19	002382	蓝帆医疗	231,779	4,832,592.15	1.17
20	002056	横店东磁	369,500	4,803,500.00	1.16
21	002078	太阳纸业	356,800	4,763,280.00	1.15
22	002281	光迅科技	191,500	4,710,900.00	1.14
23	600803	新奥股份	284,800	4,702,048.00	1.14
24	000930	中粮科技	519,600	4,681,596.00	1.13
25	601636	旗滨集团	252,000	4,677,120.00	1.13
26	300002	神州泰岳	957,100	4,641,935.00	1.12
27	603883	老百姓	87,700	4,620,036.00	1.12
28	300271	华宇软件	239,200	4,604,600.00	1.11
29	601598	中国外运	904,700	4,568,735.00	1.11
30	600649	城投控股	946,200	4,503,912.00	1.09
31	002745	木林森	335,700	4,498,380.00	1.09
32	000089	深圳机场	574,800	4,466,196.00	1.08
33	002396	星网锐捷	208,800	4,457,880.00	1.08
34	000031	大悦城	1,227,300	4,418,280.00	1.07
35	002690	美亚光电	76,800	4,282,368.00	1.04
36	600729	重庆百货	153,100	4,202,595.00	1.02
37	002839	张家港行	768,600	4,181,184.00	1.01
38	600256	广汇能源	1,244,700	4,144,851.00	1.00
39	000898	鞍钢股份	928,600	4,132,270.00	1.00
40	600500	中化国际	514,500	4,043,970.00	0.98
41	600739	XD 辽宁成	188,800	3,928,928.00	0.95
42	002926	华西证券	390,300	3,758,589.00	0.91
43	300223	北京君正	35,300	3,562,476.00	0.86
44	002266	浙富控股	705,460	3,520,245.40	0.85
45	601992	金隅集团	1,252,800	3,370,032.00	0.82
46	000960	锡业股份	208,200	3,337,446.00	0.81
47	000807	云铝股份	266,500	3,171,350.00	0.77
48	000970	中科三环	325,200	3,105,660.00	0.75
49	600166	福田汽车	888,000	3,063,600.00	0.74
50	600120	浙江东方	715,770	3,063,495.60	0.74
51	600859	王府井	102,400	2,957,312.00	0.72
52	002648	卫星石化	69,980	2,742,516.20	0.66
53	600141	兴发集团	142,000	2,673,860.00	0.65
54	600879	航天电子	352,500	2,650,800.00	0.64
55	600410	华胜天成	340,200	2,639,952.00	0.64
56	002563	森马服饰	218,000	2,605,100.00	0.63
57	002603	以岭药业	88,600	2,583,576.00	0.63

58	600563	法拉电子	16,304	2,581,901.44	0.63
59	600549	厦门钨业	123,200	2,566,256.00	0.62
60	000501	鄂武商 A	218,800	2,559,960.00	0.62
61	601699	潞安环能	213,900	2,526,159.00	0.61
62	002030	达安基因	113,271	2,405,876.04	0.58
63	600528	中铁工业	293,200	2,374,920.00	0.58
64	600398	海澜之家	327,900	2,373,996.00	0.57
65	600867	通化东宝	183,900	2,195,766.00	0.53
66	300058	蓝色光标	351,823	2,128,529.15	0.52
67	603260	合盛硅业	26,600	2,045,806.00	0.50
68	600388	龙净环保	233,900	1,992,828.00	0.48
69	300133	华策影视	333,600	1,974,912.00	0.48
70	688208	道通科技	22,655	1,970,758.45	0.48
71	001914	招商积余	108,900	1,870,902.00	0.45
72	601139	深圳燃气	257,600	1,689,856.00	0.41
73	300618	寒锐钴业	21,000	1,655,640.00	0.40
74	600901	江苏租赁	303,300	1,577,160.00	0.38
75	000999	华润三九	55,600	1,487,300.00	0.36
76	603355	莱克电气	23,500	1,462,405.00	0.35
77	000959	首钢股份	250,400	1,407,248.00	0.34
78	600779	水井坊	11,000	1,389,850.00	0.34
79	000738	航发控制	60,800	1,266,464.00	0.31
80	300113	顺网科技	95,700	1,238,358.00	0.30
81	601168	西部矿业	102,900	1,227,597.00	0.30
82	601928	凤凰传媒	168,100	1,200,234.00	0.29
83	600022	山东钢铁	682,600	1,174,072.00	0.28
84	600704	物产中大	127,100	1,000,277.00	0.24
85	603077	和邦生物	457,500	951,600.00	0.23
86	601333	广深铁路	442,300	937,676.00	0.23
87	002709	天赐材料	8,700	927,246.00	0.22
88	002966	苏州银行	122,500	900,375.00	0.22
89	600546	山煤国际	122,100	876,678.00	0.21
90	600862	中航高科	24,800	763,344.00	0.18
91	600350	山东高速	112,500	691,875.00	0.17
92	000039	中集集团	37,700	685,386.00	0.17
93	000998	隆平高科	37,200	596,688.00	0.14
94	002701	奥瑞金	114,300	587,502.00	0.14
95	600699	均胜电子	20,700	528,264.00	0.13
96	601689	拓普集团	13,200	494,076.00	0.12
97	600835	上海机电	28,000	455,000.00	0.11
98	600377	宁沪高速	41,900	408,944.00	0.10
99	600201	生物股份	22,400	390,880.00	0.09

100	002249	大洋电机	64,900	340,725.00	0.08
101	600418	江淮汽车	25,000	310,750.00	0.08
102	300010	豆神教育	53,500	303,345.00	0.07
103	600498	烽火通信	14,800	275,724.00	0.07
104	002458	益生股份	26,070	259,917.90	0.06
105	688088	虹软科技	4,580	255,335.00	0.06
106	002340	格林美	22,300	208,505.00	0.05

7.3.2 期末积极投资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	688111	金山办公	12,001	4,737,994.80	1.15
2	601678	滨化股份	522,700	4,134,557.00	1.00
3	000949	新乡化纤	478,900	4,056,283.00	0.98
4	002636	金安国纪	247,400	4,012,828.00	0.97
5	600512	腾达建设	1,296,900	3,942,576.00	0.95
6	601628	中国人寿	114,700	3,887,183.00	0.94
7	000917	电广传媒	784,800	3,853,368.00	0.93
8	603738	泰晶科技	98,900	3,414,028.00	0.83
9	603337	杰克股份	126,100	3,370,653.00	0.82
10	601588	北辰实业	1,386,400	3,244,176.00	0.79
11	000915	华特达因	119,590	3,196,640.70	0.77
12	600688	XD 上海石	820,800	3,086,208.00	0.75
13	300639	凯普生物	81,466	2,689,192.66	0.65
14	601827	三峰环境	245,700	2,326,779.00	0.56
15	000936	华西股份	329,000	2,303,000.00	0.56
16	000700	模塑科技	353,400	1,961,370.00	0.47
17	603678	火炬电子	21,500	1,451,250.00	0.35
18	002022	科华生物	74,200	1,328,922.00	0.32
19	601377	兴业证券	128,500	1,241,310.00	0.30
20	000560	我爱我家	274,800	1,228,356.00	0.30
21	600711	盛屯矿业	156,500	1,115,845.00	0.27
22	300573	兴齐眼药	7,400	1,043,622.00	0.25
23	300726	宏达电子	12,900	909,321.00	0.22
24	600108	亚盛集团	271,000	766,930.00	0.19
25	600338	西藏珠峰	50,800	719,836.00	0.17
26	002274	华昌化工	70,100	705,907.00	0.17
27	002645	华宏科技	43,400	693,532.00	0.17
28	300803	指南针	17,600	679,360.00	0.16
29	000818	航锦科技	23,100	669,669.00	0.16
30	600123	兰花科创	83,500	646,290.00	0.16
31	688696	极米科技	680	530,563.20	0.13

32	000725	京东方 A	79,300	494,832.00	0.12
33	688399	硕世生物	2,800	472,080.00	0.11
34	601319	中国人保	74,400	441,192.00	0.11
35	603606	东方电缆	19,700	396,758.00	0.10
36	300280	紫天科技	10,400	379,704.00	0.09
37	601888	中国中免	1,245	373,624.50	0.09
38	688083	中望软件	638	334,363.04	0.08
39	603517	绝味食品	3,765	317,351.85	0.08
40	688538	和辉光电	87,336	295,195.68	0.07
41	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.02
42	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.02
43	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
44	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.02
45	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
46	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.02
47	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.02
48	300919	中伟股份	433	70,579.00	0.02
49	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.02
50	300957	贝泰妮	217	54,675.32	0.01
51	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
52	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
53	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
54	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
55	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.01
56	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
57	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
58	300973	立高食品	297	34,365.87	0.01
59	300979	华利集团	379	33,162.50	0.01
60	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
61	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
62	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
63	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
64	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
65	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
66	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
67	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
68	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
69	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
70	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
71	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
72	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
73	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
74	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00

75	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
76	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
77	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
78	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
79	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
80	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
81	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
82	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
83	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
84	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
85	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
86	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
87	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
88	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
89	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
90	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
91	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
92	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
93	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
94	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
95	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
96	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
97	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
98	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
99	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
100	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
101	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
102	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
103	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
104	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
105	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
106	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
107	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
108	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
109	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
110	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
111	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
112	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
113	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	000975	银泰黄金	15,308,939.50	3.92
2	600426	华鲁恒升	12,949,764.00	3.32
3	600507	方大特钢	11,426,276.64	2.93
4	603816	顾家家居	11,388,295.00	2.92
5	002511	中顺洁柔	10,737,272.00	2.75
6	002416	爱施德	10,710,313.44	2.74
7	000959	首钢股份	10,577,916.76	2.71
8	002636	金安国纪	10,324,974.58	2.64
9	002382	蓝帆医疗	10,290,471.81	2.64
10	300244	迪安诊断	10,149,620.92	2.60
11	601636	旗滨集团	9,852,980.00	2.52
12	603486	科沃斯	9,528,256.00	2.44
13	000898	鞍钢股份	9,403,476.00	2.41
14	002078	太阳纸业	9,253,333.00	2.37
15	600901	江苏租赁	9,227,225.00	2.36
16	300146	汤臣倍健	9,196,823.70	2.36
17	601233	桐昆股份	9,160,400.00	2.35
18	600256	广汇能源	8,796,665.00	2.25
19	600132	重庆啤酒	8,772,206.00	2.25
20	002867	周大生	8,703,100.60	2.23
21	601139	深圳燃气	8,671,484.60	2.22
22	300618	寒锐钴业	8,659,808.00	2.22
23	000830	鲁西化工	8,637,979.00	2.21
24	001914	招商积余	8,368,440.58	2.14
25	300699	光威复材	8,303,600.00	2.13
26	601865	福莱特	8,153,030.72	2.09
27	601598	中国外运	8,118,033.34	2.08
28	601992	金隅集团	8,049,455.00	2.06
29	300496	中科创达	7,962,470.96	2.04

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	300595	欧普康视	17,533,721.80	4.49
2	300012	华测检测	15,501,972.18	3.97
3	000975	银泰黄金	14,264,777.14	3.65
4	600426	华鲁恒升	13,974,058.24	3.58
5	002511	中顺洁柔	12,965,280.30	3.32
6	300618	寒锐钴业	12,818,800.35	3.28

7	002416	爱施德	12,537,952.44	3.21
8	600507	方大特钢	12,499,103.41	3.20
9	000959	首钢股份	12,181,608.70	3.12
10	603816	顾家家居	11,905,287.92	3.05
11	300274	阳光电源	11,446,016.00	2.93
12	000600	建投能源	10,255,139.29	2.63
13	002557	洽洽食品	10,150,956.67	2.60
14	603882	金域医学	10,080,773.97	2.58
15	002027	分众传媒	9,762,701.97	2.50
16	002382	蓝帆医疗	9,510,803.83	2.44
17	002028	思源电气	9,448,689.56	2.42
18	001914	招商积余	9,410,835.00	2.41
19	600132	重庆啤酒	9,329,130.76	2.39
20	601233	桐昆股份	8,876,116.00	2.27
21	002385	大北农	8,863,064.17	2.27
22	002064	华峰化学	8,797,017.22	2.25
23	600028	中国石化	8,757,001.40	2.24
24	300699	光威复材	8,674,157.00	2.22
25	300394	天孚通信	8,544,601.53	2.19
26	601865	福莱特	8,490,274.18	2.17
27	600643	爱建集团	8,464,744.07	2.17
28	002318	久立特材	8,438,750.30	2.16
29	300496	中科创达	8,325,533.96	2.13
30	300244	迪安诊断	8,292,763.88	2.12
31	002867	周大生	8,180,959.70	2.10
32	603444	吉比特	7,994,440.16	2.05
33	600985	淮北矿业	7,908,980.00	2.03
34	600728	佳都科技	7,886,839.87	2.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,337,798,269.11
卖出股票收入（成交）总额	1,373,262,695.81

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期内未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期内未持有债券投资。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,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套期保值操作。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

在报告期内,本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

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	40,821.73
2	应收证券清算款	4,759,741.90
3	应收股利	—
4	应收利息	3,154.00
5	应收申购款	837,350.20
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,641,067.83

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不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 (%)
42,010	6,352.55	112,843,460.16	42.28	154,027,199.52	57.72

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	于兆瑞	135,495.00	4.44
2	姜卫平	133,528.00	4.37
3	傅新彩	126,271.00	4.13
4	马超	92,696.00	3.03
5	田红梅	65,850.00	2.16
6	郎虹	62,054.00	2.03
7	程艳萍	59,937.00	1.96

8	丁强	55,964.00	1.83
9	孙慧贤	55,593.00	1.82
10	杨杭海	51,238.00	1.68

注：持有人为本基金场内持有人。

8.3 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	12,630.42	0.0047

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 11 月 6 日） 基金份额总额	283,184,730.54
本报告期期初基金份额总额	287,765,245.64
本报告期基金总申购份额	71,637,543.37
减：本报告期基金总赎回份额	92,532,129.33
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	266,870,659.68

§ 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基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本公司于 2021 年 2 月 23 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，自 2021 年 2 月 23 日起，由徐娇娇女士担任公司督察长。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期,基金管理人、托管人及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。报告期内,公司收到北京证监局对公司采取警示措施的决定。公司已及时完成了整改,提升了内控水平。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	391,388,632.56	14.47%	364,506.14	14.47%	-
东吴证券	1	366,981,655.51	13.57%	341,773.15	13.57%	-
国盛证券	2	265,116,883.43	9.80%	246,906.92	9.80%	-
天风证券	1	236,270,869.76	8.74%	220,041.26	8.74%	-
财信证券	2	203,064,603.01	7.51%	189,119.00	7.51%	-
兴业证券	1	197,868,355.15	7.32%	184,275.63	7.32%	-
银河证券	2	186,350,132.84	6.89%	173,551.72	6.89%	-
华创证券	1	176,972,207.26	6.54%	164,815.26	6.54%	-
申万宏源	2	145,113,159.20	5.37%	135,143.88	5.37%	-
中信建投	2	121,523,894.14	4.49%	113,182.87	4.49%	-
西南证券	2	93,222,421.08	3.45%	86,819.24	3.45%	-
海通证券	1	90,390,816.43	3.34%	84,181.80	3.34%	-
东方财富	1	81,432,886.71	3.01%	75,839.01	3.01%	-
广发证券	1	71,213,475.09	2.63%	66,319.83	2.63%	-
国泰君安	1	51,472,823.15	1.90%	47,938.12	1.90%	-
华西证券	1	25,880,456.47	0.96%	24,103.34	0.96%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-

长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	4	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：（一）2021 年上半年本基金新增华安证券、华创证券交易单元。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	15,687,360.00	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于旗下部分基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引〉修订法律文件有关条款的公告》	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2021 年 3 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101~20210630	65,723,971.36	-	-	65,723,971.36	24.63
产品特有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况,易发生巨额赎回的情况,存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险,以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注:报告期内,申购份额含红利再投资份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人和托管人住所。

12.3 查阅方式

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

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

泰达宏利基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日