

# 泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券 投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 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。

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	6#
2.4 信息披露方式.....	6#
2.5 其他相关资料.....	6#
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8#</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8#
3.2 基金净值表现.....	8#
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10#
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11#</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11#
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12#
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12#
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.....	14#
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14#
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15#
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16#
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17#
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	17#
4.10 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.....	17#
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18#</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18#
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.....	18#
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18#
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19#</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19#
6.2 审计报告的基本内容.....	19#
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22#</b>
7.1 资产负债表.....	22#
7.2 利润表.....	23#
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25#
7.4 报表附注.....	27#
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>56#</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	56#
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	56#
8.3 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.....	58#
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73#
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	75#
8.6 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.....	75#

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细 .....	75#
8.8 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 .....	75#
8.9 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 .....	75#
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	75#
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	75#
8.12 投资组合报告附注 .....	75#
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>77#</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	77#
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	77#
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78#
9.4 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的情况 .....	78#
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>79#</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>80#</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	80#
11.2 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 .....	80#
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80#
11.4 基金投资策略的改变 .....	80#
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	80#
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	80#
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80#
11.8 其他重大事件 .....	82#
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>96#</b>
12.1 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 .....	96#
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	96#
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>97#</b>
13.1 备查文件目录 .....	97#
13.2 存放地点 .....	97#
13.3 查阅方式 .....	97#

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金		
基金简称	泰信基本面 400 指数分级		
场内简称	泰信 400		
基金主代码	162907		
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)		
基金合同生效日	2012 年 9 月 7 日		
基金管理人	泰信基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	45,891,373.84 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	2012 年 9 月 21 日		
下属分级基金的基金简称	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
下属分级基金的场内简称	泰信 400A	泰信 400B	泰信 400
下属分级基金的交易代码	150094	150095	162907
报告期末下属分级基金份额总额	905,303.00 份	905,303.00 份	44,080,767.84 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证锐联基本面 400 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证锐联基本面 400 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率 (税后)}$

风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期收益。

### 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		泰信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	郭明
	联系电话	021-20899098	(010) 66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	(010) 66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区浦东南路 256 号 华夏银行大厦 36-37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		万众	易会满

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ftfund.com">http://www.ftfund.com</a>
基金年度报告备置地点	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
----	----	------

会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-458,482.68	-69,463.76	-8,177,490.64
本期利润	-16,247,330.19	1,623,120.98	-9,422,454.73
加权平均基金份额本期利润	-0.2706	0.0235	-0.1490
本期加权平均净值利润率	-34.07%	3.10%	-20.03%
本期基金份额净值增长率	-29.70%	2.03%	-16.23%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	6,710,835.24	21,306,642.58	16,978,083.26
期末可供分配基金份额利润	0.1462	0.2830	0.2950
期末基金资产净值	38,119,756.43	56,778,325.95	43,949,667.13
期末基金份额净值	0.831	0.754	0.764
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	21.29%	72.53%	69.10%

注：1、本基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。

2、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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。

4、期末可供分配利润是指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
过去三个月	-11.31%	1.69%	-11.10%	1.72%	-0.21%	-0.03%
过去六个月	-16.65%	1.46%	-16.67%	1.47%	0.02%	-0.01%
过去一年	-29.70%	1.41%	-29.62%	1.42%	-0.08%	-0.01%



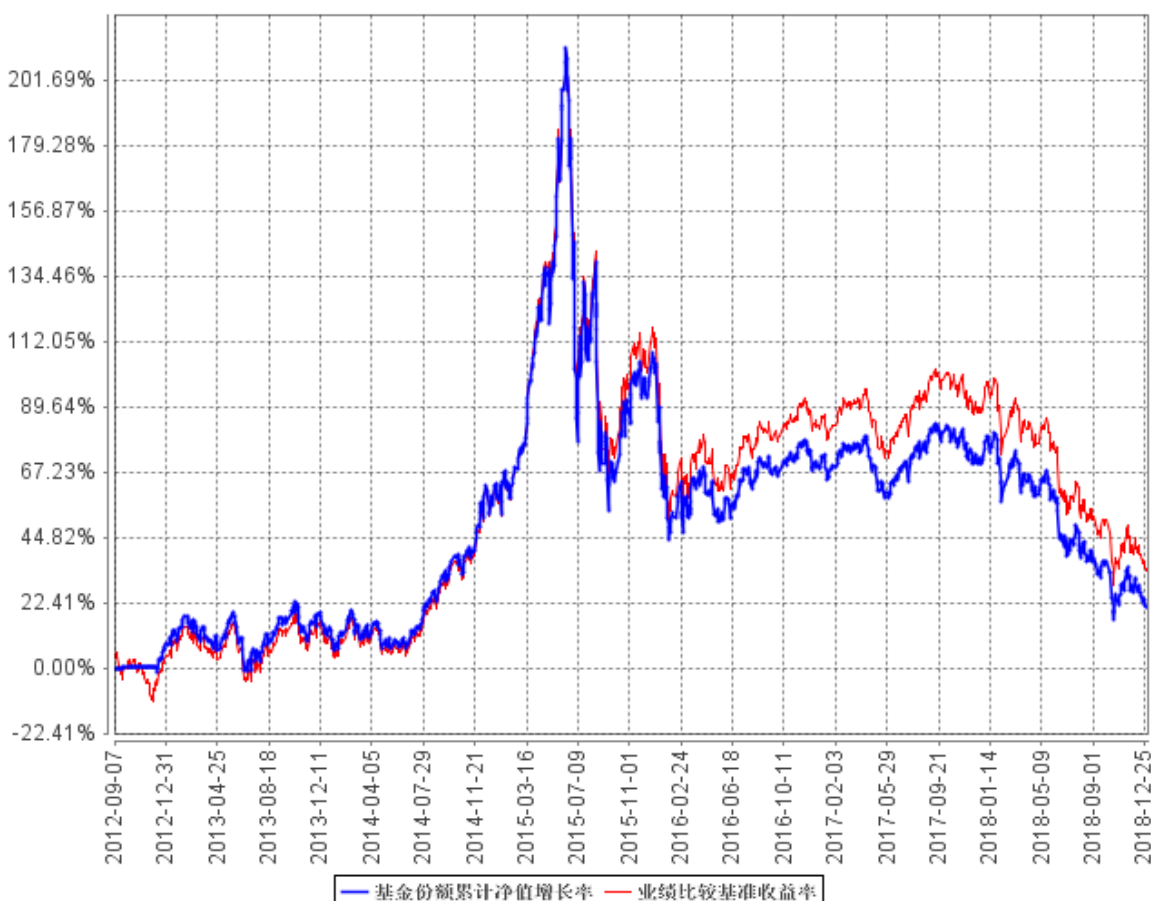
过去三年	-39.91%	1.38%	-36.37%	1.38%	-3.54%	0.00%
过去五年	6.53%	1.73%	20.83%	1.72%	-14.30%	0.01%
自基金合同生效起至今	21.29%	1.63%	33.99%	1.65%	-12.70%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为： $95\% \times$  中证锐联基本面 400 指数收益率  $+ 5\% \times$  商业银行人民币活期存款利率（税后）

中证锐联基本面 400 指数以沪深 A 股为样本空间，挑选基本面价值排列第 201 至第 600 家的上市公司作为样本，基本面价值由四个财务指标来衡量：营业收入、现金流、净资产和分红；样本股的权重配置由基本面价值决定，在一定程度上打破了样本市值与其权重之间的关联，避免了传统市值指数中过多配置高估股票的现象。

### 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

基金份额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

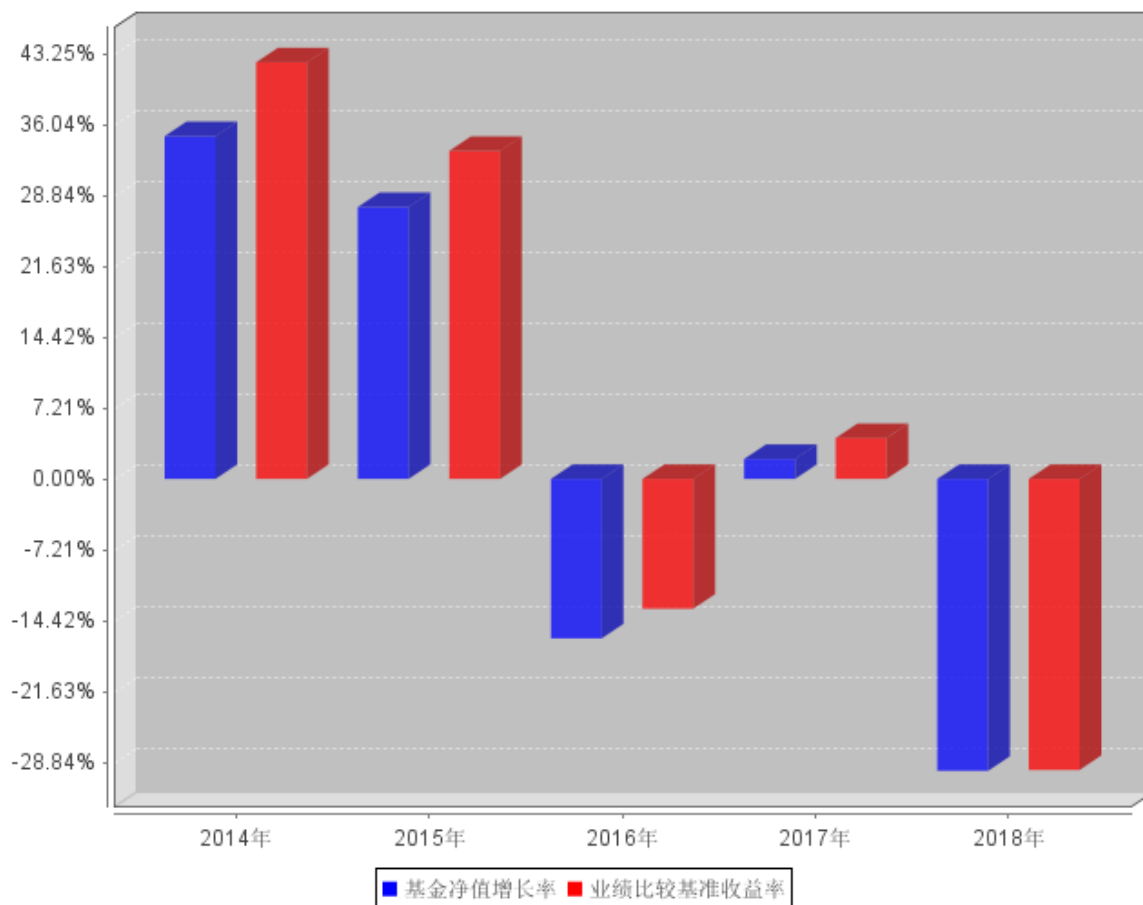


注：1、本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

## § 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

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：万众

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：姚慧

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、产品部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2018 年 12 月底，公司有正式员工 100 人，多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

截至 2018 年 12 月 31 日，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信中证基本面 400 指数分级、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长、泰信鑫利混合、泰信竞争优选混合共 21 只开放式基金及 8 个资产管理计划。

#### 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		
张彦先生	本基金经理兼泰信中证 200 指数基金、泰信智选成长混合基金经理	2015 年 1 月 6 日	-	12 年	研究生硕士。具有基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，担任高级研究员。自 2011 年 10 月至 2014 年 5 月任泰信中小盘精选基金经理助理。2012 年 4 月至 2015 年 1 月任泰信优势增长混合基金经理助理。自 2015 年 1 月 6 日起同时担任泰信中证 200 指数基金经理；自 2017 年 11 月 15 日起担任泰信智选成长混合基金经理。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18 号），公司

制定了《泰信基金管理有限公司公平交易制度》，主要控制方法如下：

- 1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。
- 2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。
- 3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。
- 4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

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。
- 5、集中交易室负责所有投资指令的执行，必须确保所有同向指令的公平公正，平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令，交易室应立即停止执行指令，并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令，不同投资组合也必须公平对待，主要采取成交结果按比例分配和轮侯方式处理。
- 6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的同时反向交易，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。
- 7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数，强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同向指令执行公平委托。
- 8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析，对强制公平委托的执行过程与结果进行检查；对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，并完成定期分析报告。

#### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司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。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 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

2018 年，我国 A 股市场整体处于下跌态势。沪指在 1 月 29 日创 3587.03 点年内新高，随后震荡下行，随着中美贸易战的加剧和国内经济形势的下滑，年度跌幅 24.59%，深证成指年度跌幅 34.42%，在全球重要指数中跌幅居前。从板块来看，年内所有行业均出现下跌。休闲服务、银行、食品饮料跌幅最少，而电子、有色、传媒跌幅最大。

报告期内，本基金作为被动操作的指数基金，严格执行基金合同规定的投资策略，按照规定的投资策略和方法进行投资操作，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，报告期内跟踪误差控制在 0.99%。报告期跟踪误差主要是由于基金申购赎回和标的指数成分股定期调整等因素所造成。

##### 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 0.831 元；本报告期基金份额净值增长率为-29.70%，业绩比较基准收益率为-29.62%。

#### 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 2019 年，经济形势依然严峻，但是由于去年的大跌，市场估值整体处于底部区域，伴随着货币政策的放松，市场具有结构性行情。

2018 年美国 GDP 强劲，欧洲经济增长不及预期及贸易摩擦避险情绪等推升美元走强。强美元带来全球资产价格的重估。中美分歧对 A 股风险偏好的压制贯穿 2018 年，对基本面的影响也逐渐显现。展望 2019 年，变化在于“中美贸易战”在 G20 后有望通过谈判实现软平衡，而围绕科技主线的长期博弈依然继续。2019 年 A 股主导力量从外部转向内部，最大的看点是经济何时见底，政策如何演绎。

2019 年经济增长压力将加速释放，而另一个方面，稳增长政策更值得期待。我们认为 2019 年政策展望上主要可以集中在两个方面。一方面是宏观减税政策。近期的中央经济工作会议提出，“宏观调控要强化逆周期调节”，“积极的财政政策要加力提效，实施更大规模的减税降费，较

大幅度增加地方政府专项债券规模”，2019 年个税的减税已经全面开始施行，而未来随着经济下行压力加大，稳增长政策出台节奏也会加快。另一方面，资本市场改革的战略高度前所未有，特别是在助力加速经济转型方面。近期资本市场改革成效已经开始渐渐显现，政策落地在全面提速。第一，并购重组在政策松绑下迎来回暖。第二，股权质押风险有所缓解。10 月份以来，地方政府到金融机构的政策出台不断，股权质押规模从 11 月份显现下行，证监会在 12 月已提出股权质押风险大致可控，第三，长线资金入场股市在加速。第四，科创板和试点注册制也有望加速推进。按照“高标准、快推进、稳起步、强功能、控风险、渐完善”的工作思路，加快制定业务规则和配套制度，努力建设一个充满生机和活力的科创板市场，推动注册制形成可复制可推广的典型样本。

从股市破净、估值、换手率、市值分布等指标及科创板预期看，A 股具备底部特征，从稳增长政策和宽松的货币政策组合变化来看，19 年是权益市场修复之年，具有估值修复微观基础，个股的机会优于指数的投资机会。

作为指数分级型基金产品，我们将坚持指数化投资策略，严格控制基金相对目标指数（基本面 400 指数）的偏离度，跟踪市场趋势，使得投资者可以清晰地把握分级子基金的交易情况，把握住投资时机。本基金将继续规范运作，审慎投资，勤勉尽责地维护基金份额持有人利益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。

##### 1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规，及时补充及完善了内部管理制度，同时对业务流程进一步梳理，严格按照监管要求进行风险控制评估及合规管理有效性评估，确保风险控制及合规管理的有效性，不断提升内部控制水平。

##### 2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制。

(1) 加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议、政策法规规定对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。根据证监会发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，制定和修订了一系列公司相关制度和流程，加强了对旗下公募基金的流动性管控，包括投资指标阅

值设置、交易对手及质押品管控等。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集，提示投研部门注意投资风险。

(2) 规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易，对基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标进行预警监控。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

3、针对基金投资运作通过日常监察与专项稽核相结合，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，通过查漏补缺、及时整改强化了风险控制流程，提高了投资管理及运营相关人员的风险意识水平，从而较好地预防风险，维护基金持有人利益。

4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

5、公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽，对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。加强投研人员的资讯管理，本年度公司购买了手机保管箱，在保管箱上方安装了探头，对基金经理、交易人员在交易时间的移动电话、掌上电脑等移动通讯工具实行集中管理，规范了手机上交异常记录表，不定期抽查；对基金经理集中区域进行录像监控，对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内，本基金的投资运作各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生，本科学历。2002 年加入泰信基金管理公司，现任公司副总经理。

委员会成员：

张敬燕女士，硕士。2017 年加入泰信基金管理有限公司，曾任公司风险管理部副总监。

蔡海成先生，硕士。2013 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司清算会计部总监。



朱志权先生，学士。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，现任基金投资部总监兼投资总监，泰信优势增长混合基金、泰信智选成长混合基金经理。

梁剑先生，硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，现任研究部副总监兼研究副总监。

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

无。

#### **4.10 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**

本报告期本基金于 2018 年 6 月 19 日至 2018 年 12 月 28 日有连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。本公司向中国证监会报告并提出解决方案，转换运作方式并修改基金合同。

## § 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，本基金托管人在对泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 21238 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金(以下简称“泰信基本面 400 指数分级基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了泰信基本面 400 指数分级基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰信基本面 400 指数分级基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰信基本面 400 指数分级基金的基金管理人泰信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰信基本面 400 指数分级基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰信基本面 400 指数分级基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰信基本面 400 指数分级基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰信基本面 400 指数分级基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结</p>

	<p>论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰信基本面 400 指数分级基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	许康玮	周祎
会计师事务所的地址	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,258,492.88	2,313,768.87
结算备付金		-	41,499.87
存出保证金		428.57	11,570.18
交易性金融资产	7.4.7.2	35,087,668.86	53,563,048.13
其中：股票投资		35,087,668.86	53,563,048.13
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,093,599.16
应收利息	7.4.7.5	648.76	695.18
应收股利		-	-
应收申购款		3,795.44	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		38,351,034.51	57,024,181.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	2,333.73
应付管理人报酬		33,545.18	49,330.02
应付托管费		7,379.95	10,852.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	322.76	8,599.13
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	190,030.19	174,739.95
负债合计		231,278.08	245,855.44
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	31,408,921.19	32,997,977.88
未分配利润	7.4.7.10	6,710,835.24	23,780,348.07
所有者权益合计		38,119,756.43	56,778,325.95
负债和所有者权益总计		38,351,034.51	57,024,181.39

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额净值为 0.831 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额参考净值为 1.026 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额参考净值为 0.636 元；基金份额总额为 45,891,373.84 份，其中泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额为 44,080,767.84 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额为 905,303.00 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额为 905,303.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-15,316,414.86	2,650,103.98
1.利息收入		23,286.95	32,512.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	23,286.95	32,512.78
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		442,939.85	870,949.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-317,709.35	404,830.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	760,649.20	466,118.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-15,788,847.51	1,692,584.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	6,205.85	54,056.87
<b>减：二、费用</b>		930,915.33	1,026,983.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	477,131.98	521,061.76
2. 托管费	7.4.10.2.2	104,969.06	114,633.61
3. 销售服务费		-	-



4. 交易费用	7.4.7.18	42,692.06	105,250.46
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	7.4.7.19	306,122.23	286,037.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,247,330.19	1,623,120.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,247,330.19	1,623,120.98

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	32,997,977.88	23,780,348.07	56,778,325.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,247,330.19	-16,247,330.19
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）	-1,589,056.69	-822,182.64	-2,411,239.33
其中：1. 基金申购款	1,350,935.78	584,946.57	1,935,882.35
2. 基金赎回款	-2,939,992.47	-1,407,129.21	-4,347,121.68

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）	31,408,921.19	6,710,835.24	38,119,756.43
项目	上年度可比期间		
	2017年1月1日至2017年12月31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）	26,069,783.67	17,879,883.46	43,949,667.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,623,120.98	1,623,120.98
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）	6,928,194.21	4,277,343.63	11,205,537.84
其中：1. 基金申购款	32,847,451.50	23,956,083.26	56,803,534.76
2. 基金赎回款	-25,919,257.29	-19,678,739.63	-45,597,996.92
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）	32,997,977.88	23,780,348.07	56,778,325.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

葛航

韩波

蔡海成

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金(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[2012]第 252 号《关于核准泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金募集的批复》核准,由泰信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《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约开放型,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 300,797,873.45 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 346 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 300,843,720.90 份,其中认购资金利息折合 45,847.45 份。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“泰信基本面 400 份额”)、泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“泰信基本面 400A 份额”)与泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“泰信基本面 400B 份额”)。其中,泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的规定,每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日为基金份额折算基准日,本基金将对泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400 份额进行应得收益的定期份额折算。泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行参考净值计算,对泰信基本面 400A 份额的应得收益进行定期份额折算,每 2 份泰信基本面 400 份额将按 1 份泰信基本面 400A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后,泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于泰信基本面 400A 份额期末的约定应得收益,即泰信基本面 400A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分,将折算为场内泰信基本面 400 份额分配给泰信基本面 400A 份额持有人。泰信基本面 400 份额持有人持有的每 2 份泰信基本面 400 份额将按 1 份泰信基本面 400A 份额获得新增泰信基本面 400 份额的分配。持有场外泰信基本面 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰信基本面 400 份额的分配;

持有场内泰信基本面 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰信基本面 400 份额的分配。经过上述份额折算，泰信基本面 400A 份额的基金份额参考净值和泰信基本面 400 份额的基金份额净值将相应调整。

除以上定期份额折算外，本基金根据基金合同规定，还将在以下两种情况进行份额折算，即：当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元；当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1:1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1:1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

泰信基本面 400 份额设置单独的基金代码，但不上市交易。泰信基本面 400A 份额与泰信基本面 400B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所(以下简称“深交所”)上市交易，不可单独进行申购或赎回。投资者可在场内申购和赎回泰信基本面 400 份额，投资者可选择将其场内申购的泰信基本面 400 份额按 1:1 的比例分拆成泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额，投资者可按 1:1 的配比将其持有的泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额申请合并为泰信基本面 400 份额后赎回。投资者可在场外申购和赎回泰信基本面 400 份额。场外申购的泰信基本面 400 份额不进行分拆。投资者可将其持有的场外泰信基本面 400 份额跨系统转登记至场内并申请将其分拆成泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额后上市交易。投资者可按 1:1 的配比将其持有的泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额合并为泰信基本面 400 份额后赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以

将其纳入投资范围。本基金的标的指数是中证锐联基本面 400 指数。本基金的业绩比较基准是  $95\% \times$  中证锐联基本面 400 指数收益率  $+5\% \times$  商业银行人民币活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于 2019 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 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<年度报告和半年度报告>》、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》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2018 年 12 月 31 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款

项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购、赎回以及配对转换引起的实收基金变动分别于基金申购确认日、基金赎回确认日及基金配对转换确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内，本基金(包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额)将不进行收益分配。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。



本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
活期存款	3,258,492.88	2,313,768.87
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：	3,258,492.88	2,313,768.87

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	50,752,529.51	35,087,668.86	-15,664,860.65
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	50,752,529.51	35,087,668.86	-15,664,860.65
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	53,439,061.27	53,563,048.13	123,986.86
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	53,439,061.27	53,563,048.13	123,986.86

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	648.56	671.28
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	-	18.70
应收债券利息	-	-

应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	0.20	5.20
合计	648.76	695.18

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	322.76	8,599.13
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	322.76	8,599.13

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	180,000.00	160,000.00
应付指数使用费	10,030.19	14,739.95
合计	190,030.19	174,739.95

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	75,301,291.40	32,997,977.88
本期申购	3,161,225.00	263,854.64
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,707,957.19	-724,181.14
2018 年 6 月 20 日 基金拆分/份 额折算前	76,754,559.21	32,537,651.38
基金拆分/份额折算变动份额	-29,213,562.06	-
本期申购	1,588,569.81	1,087,081.14
本期赎回 (以“-”号填列)	-3,238,193.12	-2,215,811.33
本期末	45,891,373.84	31,408,921.19

注：1. 截至 2018 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 1,810,606.00 份，其中泰信基本面 400A 份额 905,303.00 份，泰信基本面 400B 份额 905,303.00 份(2017 年 12 月 31 日：7,472,706.00 份，其中泰信基本面 400A 份额 3,736,353.00 份，泰信基本面 400B 份额 3,736,353.00 份)，托管在场内未上市交易的基金份额为 281,318.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 43,799,449.84 份，均为泰信基本面 400 份额。(2017 年 12 月 31 日：托管在场内未上市交易的基金份额为 331,835.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 67,496,750.40 份，均为泰信基本面 400 份额)。场内的泰信基本面份额登记在证券登记结算系统，场外的泰信基本面份额登记在注册登记系统，可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。

2. 截至 2018 年 6 月 19 日，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 B 类份额参考净值为 0.203 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金合同》及深交所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定和《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级基金办理不定期折算业务的公告》，本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司确定 2018 年 6 月 20 日为份额折算基准日，对泰信基本面 400 份额的场内、场外份额、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额实施不定期份额折算。折算前，泰信基本面 400 场外和场内份额分别为 69,526,685.21 份和 275,532.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.619389908，折算后泰信基本面 400 场外份额总额和场内份额总额分别为 43,064,127.15 份和 2,977,538.00 份，泰信基本面 400 份额净值为 1.000 元；折算前，泰信基本

面 400A 份额总额为 3,476,171.00 份, 根据基金份额折算公式, 份额折算比例为 0.215658717, 折算后泰信基本面 400A 份额总额为 749,666.00 份, 份额净值为 1.000 元, 经份额折算后产生新增的泰信基本面 400 场内份额; 折算前, 泰信基本面 400B 份额总额为 3,476,171.00 份, 根据基金份额折算公式, 份额折算比例为 0.215658717, 折算后泰信基本面 400B 份额总额为 749,666.00 份, 份额净值为 1.000 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例, 对全体基金份额持有人持有的泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额进行了折算, 并于 2018 年 6 月 22 日进行了变更登记。

#### 7.4.7.10 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	21,306,642.58	2,473,705.49	23,780,348.07
本期利润	-458,482.68	-15,788,847.51	-16,247,330.19
本期基金份额交易产生的变动数	-1,023,723.76	201,541.12	-822,182.64
其中: 基金申购款	866,267.64	-281,321.07	584,946.57
基金赎回款	-1,889,991.40	482,862.19	-1,407,129.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,824,436.14	-13,113,600.90	6,710,835.24

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	22,512.15	31,608.73
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	196.14	539.55
其他	578.66	364.50

合计	23,286.95	32,512.78
----	-----------	-----------

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出股票成交总额	14,937,894.78	31,467,772.15
减：卖出股票成本总额	15,255,604.13	31,062,941.51
买卖股票差价收入	-317,709.35	404,830.64

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
股票投资产生的股利收益	760,649.20	466,118.95
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	760,649.20	466,118.95



**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-15,788,847.51	1,692,584.74
——股票投资	-15,788,847.51	1,692,584.74
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	-15,788,847.51	1,692,584.74

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	6,205.85	54,056.87
合计	6,205.85	54,056.87

注：本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。本基金对于持续持有期大于等于 7 日的投资者，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%，本基金收取的赎回费中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	42,692.06	105,250.46
银行间市场交易费用	-	-
合计	42,692.06	105,250.46

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
债券账户维护费—— 中债登	18,000.00	4,500.00
指数使用费	47,713.23	52,106.17
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	409.00	431.00
债券账户维护费—— 上清所	-	9,000.00
合计	306,122.23	286,037.17

注：根据泰信基金管理有限公司 2016 年 8 月 5 日公布的《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金调整指数许可使用费并修改基金合同的公告》，经与本基金的托管人中国工商银行股份有限公司以及中证指数有限公司协商一致后，并报中国证监会备案，泰信基金管理有限公司决定调整本基金的指数许可使用费和每季度指数许可使用费的收取下限，并相应对《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》内容进行修订。修订后的相关合同条款规定：如果本基金前一年度日均资产规模净值超过或等于 40 亿元，则本年度的指数许可使用基点费按照万分九的年费率计提；如果不足 40 亿元，则本年度的指数许可使用费按照万分之十的年费率计提。基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用费人民币 5 万元的收取下限，则该下限超

出当季累计指数使用费的部分(即：每季指数许可使用费收取下限减当季累计指数许可使用费)由基金管理人自行承担，不作为基金费用从基金财产中列支。标的指数许可使用费每日计算，逐日累计。计算方法如下：

日指数许可使用费=前一日基金资产净值×适用的指数许可使用费率/当年天数。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金合同》及深交所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2019 年 1 月 2 日为份额折算基准日，对泰信基本面 400 的场内份额、场外份额和泰信基本面 400A 份额实施定期份额折算。

于 2019 年 2 月 22 日，本基金管理人已收到《关于准予泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金变更注册的批复》。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
山东省国际信托股份有限公司(“山东国托”)	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司	基金管理人的股东

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

**7.4.10.1.2 债券交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**7.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	477,131.98	521,061.76
其中：支付销售机构的客户维护费	54,100.59	52,646.72

注：支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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 × 1.00%/ 当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	104,969.06	114,633.61

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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 × 0.22%/ 当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
期初持有的基金份额	-	-	24,010,861.29
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-8,637,270.40
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	15,373,590.89
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	33.50%

项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
期初持有的基金份额	-	-	11,611,612.90
期间申购/买入总份额	-	-	12,010,284.02
期间因拆分变动份额	-	-	388,964.37
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-

期末持有的基金份额	-	-	24,010,861.29
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	31.89%

注：本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司在上年度申购本基金的交易委托管理人直销中心办理，交易费用共 12,952.19 元，交易费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

泰信基本面 400				
关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山东国托	18,634,755.83	40.61%	29,104,230.83	38.65%

#### 7.4.10.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,258,492.88	22,512.15	2,313,768.87	31,608.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 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无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

### 7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002183	怡亚通	2018 年 12 月 25 日	重大事项	5.01	2019 年 1 月 2 日	4.96	33,955	326,348.15	170,114.55	-
600270	外运发展	2018 年 12 月 13 日	重大事项	20.99	-	-	4,497	88,817.95	94,392.03	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项	14.59	-	-	4,762	88,204.18	69,477.58	-
000987	越秀金控	2018 年 12 月 25 日	重大事项	7.97	2019 年 1 月 10 日	8.77	2,561	33,897.13	20,411.17	-

注：1. 根据中外运空运发展股份有限公司（以下简称“外运发展”）于 2018 年 11 月 3 日公布的《中国外运股份有限公司换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司暨关联交易报告书》和中国外运股份有限公司（以下简称“中国外运”）于 2019 年 1 月 15 日公布的《中国外运发行 A 股股份换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司上市公告书暨 2018 年第三季度财务报表》，中国外运向外运发展除中国外运以外的股东发行 A 股股票，以换股比例 1:3.8225 取得外运发展股东持有的外运发展全部股票，吸收合并外运发展；外运发展自 2018 年 12 月 13 日起连续停牌。换股合并后新增的中国外运股票于 2019 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 5.30 元。外运发展自 2018 年 12 月 28 日起终止上市并摘牌。

2. 本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的

股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事正回购交易作为抵押的债券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，泰信基本面 400A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；泰信基本面 400B 份额具有高风险、高预期收益的特征。本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪。力争将本基金的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控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人建立了以审计、合规与风险控制委员会、督察长为核心，对公司所有经营管理行为进行监督的四道监控防线。

监察稽核部对公司经营、基金投资等业务运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，如有必要则由督察长向公司董事长和中国证监会报告。目前，公司的事前、事中、事后三个控制层次的风险管理体系相对清晰。各业务部门负责事前风险防范；风险管理部负责对公司运营过程中产生或潜在的风险进行事中管理和监控，并负责运用定量分析模型，根据各基金的投资目标及投资策略，定期对基金的投资组合风险进行评估，向投资决策委员会提交业绩评估报告；监察稽核部负责对公司各项业务进行定期、不定期检查，负责事后监督。

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。



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

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

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 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 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.93%。

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。于 2018 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 37,991,766.41 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 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和存出保证金等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	3,258,492.88	-	-	-	3,258,492.88
存出保证金	428.57	-	-	-	428.57
交易性金融资产	-	-	-35,087,668.86	-	35,087,668.86
应收利息	-	-	-	648.76	648.76
应收申购款	-	-	-	3,795.44	3,795.44
资产总计	3,258,921.45	-	-35,092,113.06	-	38,351,034.51
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	33,545.18	33,545.18
应付托管费	-	-	-	7,379.95	7,379.95
应付交易费用	-	-	-	322.76	322.76
其他负债	-	-	-	190,030.19	190,030.19
负债总计	-	-	-	231,278.08	231,278.08
利率敏感度缺口	3,258,921.45	-	-34,860,834.98	-	38,119,756.43
上年度末 2017 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	2,313,768.87	-	-	-	2,313,768.87
结算备付金	41,499.87	-	-	-	41,499.87
存出保证金	11,570.18	-	-	-	11,570.18
交易性金融资产	-	-	-53,563,048.13	-	53,563,048.13
应收证券清算款	-	-	-	1,093,599.16	1,093,599.16
应收利息	-	-	-	695.18	695.18
资产总计	2,366,838.92	-	-54,657,342.47	-	57,024,181.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,333.73	2,333.73
应付管理人报酬	-	-	-	49,330.02	49,330.02

应付托管费	-	-	-	10,852.61	10,852.61
应付交易费用	-	-	-	8,599.13	8,599.13
其他负债	-	-	-	174,739.95	174,739.95
负债总计	-	-	-	245,855.44	245,855.44
利率敏感度缺口	2,366,838.92	-	-	54,411,487.03	56,778,325.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资 (2017 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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，主要采用完全复制法，按照在中证锐联基本面 400 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。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。本基金投资组合中投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	35,087,668.86	92.05	53,563,048.13	94.34
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	35,087,668.86	92.05	53,563,048.13	94.34

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	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(2018年12月 31日)	上年度末(2017年12月 31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	1,891,632.38	2,772,516.07
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-1,891,632.38	-2,772,516.07	

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

## (a) 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。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 34,733,273.53 元，属于第二层次的余额为 284,917.75 元，属于第三层次的余额为 69,477.58 元（2017 年 12 月 31 日：第一层次 51,021,398.65 元，第二层次 2,541,649.48 元，无第三层次）。

## (ii) 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的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

	交易性金融资产 权益工具投资
2018 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层次	69,477.58
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2018 年 12 月 31 日	<u>69,477.58</u>
	-

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动  
——公允价值变动损益

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

2017 年 12 月 31 日本基金无第三层次余额，2017 年度本基金未发生第三层次金额变动。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

	2018 年 12 月 31 日		名称	不可观察输入值	与公允价值之间的关系
	公允价值	估值技术		范围/加权平均值	
交易性金融资产					
——股票投资	69,477.58	市场法	市净率	3.1	正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	35,087,668.86	91.49
	其中：股票	35,087,668.86	91.49
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	3,258,492.88	8.50
8	其他各项资产	4,872.77	0.01
9	合计	38,351,034.51	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	216,244.50	0.57
B	采矿业	1,951,456.07	5.12
C	制造业	19,046,731.68	49.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供	966,455.92	2.54



	应业		
E	建筑业	1,136,621.23	2.98
F	批发和零售业	2,637,582.32	6.92
G	交通运输、仓储和邮政业	1,814,534.29	4.76
H	住宿和餐饮业	25,900.80	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,077,490.61	2.83
J	金融业	2,264,572.73	5.94
K	房地产业	2,494,215.99	6.54
L	租赁和商务服务业	540,481.67	1.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	142,012.77	0.37
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	617,539.50	1.62
S	综合	86,351.20	0.23
	合计	35,018,191.28	91.86

### 8.2.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	69,477.58	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业		-
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		-
J	金融业		-
K	房地产业		-
L	租赁和商务服务业		-
M	科学研究和技术服务业		-
N	水利、环境和公共设施管理业		-
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	69,477.58	0.18

注：积极投资股票为停牌等原因造成的被动持有非当前成分股。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	占基金资产净值比例（%）
1	601555	东吴证券	39,543	264,938.10	0.70
2	601168	西部矿业	39,168	227,957.76	0.60
3	600489	中金黄金	26,000	223,080.00	0.59
4	600522	中天科技	26,626	217,001.90	0.57
5	601997	贵阳银行	19,551	208,804.68	0.55

6	000059	华锦股份	34,500	204,930.00	0.54
7	600535	天士力	10,612	203,750.40	0.53
8	000728	国元证券	29,115	203,222.70	0.53
9	000543	皖能电力	42,426	203,220.54	0.53
10	600266	北京城建	24,600	194,832.00	0.51
11	000401	冀东水泥	15,728	194,712.64	0.51
12	600143	金发科技	38,889	192,500.55	0.50
13	000425	徐工机械	59,500	192,185.00	0.50
14	600312	平高电气	23,578	190,510.24	0.50
15	600482	中国动力	8,507	189,450.89	0.50
16	000750	国海证券	43,374	189,110.64	0.50
17	600325	华发股份	30,124	186,768.80	0.49
18	600873	梅花生物	43,820	184,920.40	0.49
19	600039	四川路桥	56,238	184,460.64	0.48
20	000623	吉林敖东	12,202	176,074.86	0.46
21	000488	晨鸣纸业	31,350	175,873.50	0.46
22	002183	怡亚通	33,955	170,114.55	0.45
23	600109	国金证券	23,656	169,376.96	0.44
24	600811	东方集团	46,205	169,110.30	0.44
25	600507	方大特钢	16,836	168,191.64	0.44
26	600655	豫园股份	22,329	165,234.60	0.43
27	000581	威孚高科	9,088	160,494.08	0.42
28	000690	宝新能源	23,832	160,389.36	0.42
29	000423	东阿阿胶	4,043	159,900.65	0.42
30	601099	太平洋	63,380	157,816.20	0.41
31	000768	中航飞机	11,908	157,661.92	0.41
32	000550	江铃汽车	12,300	156,948.00	0.41
33	600782	新钢股份	30,800	156,772.00	0.41

34	600739	辽宁成大	14,962	156,502.52	0.41
35	600699	均胜电子	6,692	156,325.12	0.41
36	002092	中泰化学	22,145	156,122.25	0.41
37	601012	隆基股份	8,783	153,175.52	0.40
38	000413	东旭光电	33,751	151,879.50	0.40
39	600498	烽火通信	5,325	151,602.75	0.40
40	000926	福星股份	24,624	150,698.88	0.40
41	000701	厦门信达	24,829	150,463.74	0.39
42	600649	城投控股	27,500	150,425.00	0.39
43	600348	阳泉煤业	29,800	150,192.00	0.39
44	000917	电广传媒	21,670	149,956.40	0.39
45	600183	生益科技	14,858	149,471.48	0.39
46	300146	汤臣倍健	8,788	149,308.12	0.39
47	600176	中国巨石	15,312	148,067.04	0.39
48	601179	中国西电	43,900	147,504.00	0.39
49	600276	恒瑞医药	2,784	146,856.00	0.39
50	000703	恒逸石化	12,700	146,304.00	0.38
51	600438	通威股份	17,600	145,728.00	0.38
52	000686	东北证券	22,744	142,377.44	0.37
53	600612	老凤祥	3,100	139,500.00	0.37
54	600801	华新水泥	8,300	138,776.00	0.36
55	000600	建投能源	27,500	138,050.00	0.36
56	600026	中远海能	31,002	137,648.88	0.36
57	002673	西部证券	17,909	137,362.03	0.36
58	600157	永泰能源	102,000	136,680.00	0.36
59	601098	中南传媒	10,926	136,575.00	0.36
60	002241	歌尔股份	19,774	136,045.12	0.36
61	600694	大商股份	5,600	135,464.00	0.36

62	002311	海大集团	5,817	134,779.89	0.35
63	600277	亿利洁能	23,613	133,649.58	0.35
64	600079	人福医药	13,134	133,178.76	0.35
65	600487	亨通光电	7,766	132,410.30	0.35
66	600096	云天化	26,293	131,727.93	0.35
67	600064	南京高科	16,650	131,202.00	0.34
68	600269	赣粤高速	33,500	130,650.00	0.34
69	600332	白云山	3,646	130,380.96	0.34
70	000961	中南建设	23,089	129,529.29	0.34
71	600282	南钢股份	37,642	128,735.64	0.34
72	000671	阳光城	24,689	128,135.91	0.34
73	300226	上海钢联	2,800	127,484.00	0.33
74	002244	滨江集团	31,990	127,320.20	0.33
75	000060	中金岭南	31,450	124,542.00	0.33
76	601666	平煤股份	35,068	123,439.36	0.32
77	002475	立讯精密	8,768	123,278.08	0.32
78	600875	东方电气	15,600	123,084.00	0.32
79	600804	鹏博士	17,474	122,842.22	0.32
80	601699	潞安环能	18,400	122,544.00	0.32
81	600256	广汇能源	32,563	122,436.88	0.32
82	002004	华邦健康	26,124	120,431.64	0.32
83	601928	凤凰传媒	14,957	118,758.58	0.31
84	601000	唐山港	49,736	118,371.68	0.31
85	600970	中材国际	21,603	118,168.41	0.31
86	000726	鲁泰 A	12,100	117,491.00	0.31
87	600567	山鹰纸业	37,505	117,015.60	0.31
88	002110	三钢闽光	9,123	116,683.17	0.31
89	002157	正邦科技	21,883	116,198.73	0.30

90	600742	一汽富维	11,595	115,718.10	0.30
91	600881	亚泰集团	34,894	115,499.14	0.30
92	600718	东软集团	9,957	115,003.35	0.30
93	601058	赛轮轮胎	51,429	114,686.67	0.30
94	600252	中恒集团	44,498	114,359.86	0.30
95	600123	兰花科创	17,392	113,395.84	0.30
96	000528	柳工	18,595	112,871.65	0.30
97	300059	东方财富	9,279	112,275.90	0.29
98	600210	紫江企业	30,790	112,075.60	0.29
99	000800	一汽轿车	16,688	110,474.56	0.29
100	600008	首创股份	32,188	110,404.84	0.29
101	002416	爱施德	18,747	110,232.36	0.29
102	000937	冀中能源	29,200	110,084.00	0.29
103	000400	许继电气	12,370	109,969.30	0.29
104	600497	驰宏锌锗	26,720	109,552.00	0.29
105	600004	白云机场	10,844	108,982.20	0.29
106	601718	际华集团	32,531	108,978.85	0.29
107	600320	振华重工	34,358	108,914.86	0.29
108	002470	金正大	17,160	108,451.20	0.28
109	600426	华鲁恒升	8,971	108,279.97	0.28
110	600160	巨化股份	16,325	108,234.75	0.28
111	000963	华东医药	4,087	108,142.02	0.28
112	002500	山西证券	18,246	108,016.32	0.28
113	603858	步长制药	4,242	107,237.76	0.28
114	600597	光明乳业	12,810	107,091.60	0.28
115	600582	天地科技	31,284	106,991.28	0.28
116	000860	顺鑫农业	3,354	106,959.06	0.28
117	600033	福建高速	36,000	106,920.00	0.28

118	600067	冠城大通	28,588	106,347.36	0.28
119	000031	中粮地产	21,749	106,135.12	0.28
120	000718	苏宁环球	33,348	106,046.64	0.28
121	600600	青岛啤酒	3,024	105,416.64	0.28
122	600380	健康元	15,801	105,392.67	0.28
123	601198	东兴证券	10,989	105,054.84	0.28
124	002456	欧菲科技	11,378	104,563.82	0.27
125	000758	中色股份	28,489	103,984.85	0.27
126	600549	厦门钨业	8,532	103,066.56	0.27
127	002129	中环股份	14,200	102,666.00	0.27
128	000685	中山公用	14,550	101,850.00	0.27
129	601233	桐昆股份	10,431	101,806.56	0.27
130	000786	北新建材	7,390	101,686.40	0.27
131	600073	上海梅林	13,540	100,873.00	0.26
132	000729	燕京啤酒	17,854	100,696.56	0.26
133	002001	新和成	6,670	100,116.70	0.26
134	600111	北方稀土	11,388	99,872.76	0.26
135	600308	华泰股份	22,800	99,180.00	0.26
136	600291	西水股份	9,630	99,092.70	0.26
137	600729	重庆百货	3,444	97,465.20	0.26
138	002422	科伦药业	4,718	97,426.70	0.26
139	600657	信达地产	24,749	97,263.57	0.26
140	000830	鲁西化工	9,921	97,225.80	0.26
141	600415	小商品城	27,770	96,917.30	0.25
142	000933	神火股份	24,600	95,940.00	0.25
143	002221	东华能源	11,892	95,849.52	0.25
144	000028	国药一致	2,298	95,229.12	0.25
145	600569	安阳钢铁	31,400	95,142.00	0.25

146	002078	太阳纸业	16,677	95,058.90	0.25
147	000012	南玻 A	23,795	94,942.05	0.25
148	600720	祁连山	14,705	94,847.25	0.25
149	002701	奥瑞金	18,711	94,677.66	0.25
150	600879	航天电子	17,480	94,566.80	0.25
151	600270	外运发展	4,497	94,392.03	0.25
152	600141	兴发集团	9,155	94,204.95	0.25
153	600835	上海机电	6,460	93,993.00	0.25
154	000683	远兴能源	39,453	93,503.61	0.25
155	601611	中国核建	14,300	93,379.00	0.24
156	600761	安徽合力	10,669	93,353.75	0.24
157	000999	华润三九	3,744	93,075.84	0.24
158	000906	浙商中拓	18,994	92,880.66	0.24
159	600020	中原高速	25,300	92,851.00	0.24
160	000960	锡业股份	9,721	92,738.34	0.24
161	600997	开滦股份	16,330	92,591.10	0.24
162	601872	招商轮船	25,054	92,449.26	0.24
163	600663	陆家嘴	7,095	92,164.05	0.24
164	000829	天音控股	16,369	91,830.09	0.24
165	601128	常熟银行	14,900	91,486.00	0.24
166	600737	中粮糖业	12,429	91,477.44	0.24
167	600056	中国医药	7,275	91,446.75	0.24
168	000951	中国重汽	8,200	91,348.00	0.24
169	002048	宁波华翔	8,681	90,542.83	0.24
170	002419	天虹股份	8,247	90,469.59	0.24
171	600939	重庆建工	19,500	89,895.00	0.24
172	002385	大北农	28,059	89,788.80	0.24
173	600409	三友化工	15,625	89,375.00	0.23



174	002242	九阳股份	5,554	88,919.54	0.23
175	002008	大族激光	2,904	88,165.44	0.23
176	600085	同仁堂	3,205	88,137.50	0.23
177	000559	万向钱潮	17,203	88,079.36	0.23
178	002440	闰土股份	9,781	88,029.00	0.23
179	600373	中文传媒	6,750	87,817.50	0.23
180	002065	东华软件	12,635	87,813.25	0.23
181	000598	兴蓉环境	21,719	87,527.57	0.23
182	002465	海格通信	11,149	86,962.20	0.23
183	601717	郑煤机	15,698	86,809.94	0.23
184	002091	江苏国泰	15,459	86,570.40	0.23
185	600895	张江高科	5,776	86,351.20	0.23
186	601231	环旭电子	9,588	86,292.00	0.23
187	600038	中直股份	2,305	86,114.80	0.23
188	002007	华兰生物	2,625	86,100.00	0.23
189	000792	盐湖股份	12,300	85,854.00	0.23
190	000501	鄂武商 A	9,038	85,680.24	0.22
191	002081	金螳螂	10,540	85,374.00	0.22
192	600502	安徽水利	23,890	85,048.40	0.22
193	600120	浙江东方	6,768	85,006.08	0.22
194	000089	深圳机场	10,906	84,957.74	0.22
195	600708	光明地产	24,200	84,458.00	0.22
196	600339	中油工程	23,100	83,853.00	0.22
197	600816	安信信托	19,130	83,598.10	0.22
198	002128	露天煤业	11,666	83,528.56	0.22
199	300070	碧水源	10,690	83,382.00	0.22
200	600466	蓝光发展	15,498	83,379.24	0.22
201	601636	旗滨集团	21,736	82,596.80	0.22

202	600017	日照港	29,926	82,595.76	0.22
203	002085	万丰奥威	10,618	82,289.50	0.22
204	600822	上海物贸	9,500	81,985.00	0.22
205	000789	万年青	7,523	81,925.47	0.21
206	601222	林洋能源	16,632	80,498.88	0.21
207	000006	深振业 A	15,508	80,331.44	0.21
208	600122	宏图高科	22,083	80,161.29	0.21
209	000877	天山股份	11,243	79,937.73	0.21
210	000050	深天马 A	8,130	79,755.30	0.21
211	600565	迪马股份	30,508	79,320.80	0.21
212	600037	歌华有线	9,227	79,259.93	0.21
213	002191	劲嘉股份	10,088	78,787.28	0.21
214	600859	王府井	5,795	78,580.20	0.21
215	600388	龙净环保	7,692	78,073.80	0.20
216	000732	泰禾集团	5,558	77,923.16	0.20
217	601866	中远海发	34,045	77,622.60	0.20
218	600138	中青旅	6,017	77,559.13	0.20
219	600633	浙数文化	9,516	77,555.40	0.20
220	002236	大华股份	6,730	77,125.80	0.20
221	000807	云铝股份	19,771	76,711.48	0.20
222	002152	广电运通	13,626	76,441.86	0.20
223	600511	国药股份	3,284	76,353.00	0.20
224	300124	汇川技术	3,767	75,867.38	0.20
225	002714	牧原股份	2,630	75,612.50	0.20
226	000902	新洋丰	8,400	75,264.00	0.20
227	002237	恒邦股份	8,941	74,925.58	0.20
228	603766	隆鑫通用	18,219	74,515.71	0.20
229	600598	北大荒	8,700	74,472.00	0.20

230	002601	龙蟠佰利	6,054	74,464.20	0.20
231	600094	大名城	20,394	74,438.10	0.20
232	600623	华谊集团	9,205	74,376.40	0.20
233	600676	交运股份	17,200	74,132.00	0.19
234	000016	深康佳 A	22,700	73,548.00	0.19
235	600787	中储股份	14,561	72,805.00	0.19
236	002375	亚厦股份	14,341	72,278.64	0.19
237	600584	长电科技	8,752	72,116.48	0.19
238	601588	北辰实业	26,549	71,947.79	0.19
239	600977	中国电影	5,019	71,872.08	0.19
240	601886	江河集团	9,577	71,731.73	0.19
241	601678	滨化股份	16,850	71,107.00	0.19
242	600588	用友网络	3,331	70,950.30	0.19
243	002233	塔牌集团	7,026	70,681.56	0.19
244	600395	盘江股份	14,070	70,490.70	0.18
245	000977	浪潮信息	4,400	70,048.00	0.18
246	000021	深科技	12,083	69,477.25	0.18
247	600743	华远地产	28,700	69,454.00	0.18
248	600315	上海家化	2,540	69,342.00	0.18
249	601216	君正集团	26,439	69,270.18	0.18
250	601880	大连港	37,353	69,103.05	0.18
251	600978	宜华生活	16,826	68,986.60	0.18
252	601966	玲珑轮胎	5,016	68,468.40	0.18
253	300408	三环集团	4,036	68,289.12	0.18
254	600959	江苏有线	16,496	67,963.52	0.18
255	601369	陕鼓动力	11,200	67,760.00	0.18
256	000417	合肥百货	15,604	67,565.32	0.18
257	600894	广日股份	12,377	67,454.65	0.18

258	600006	东风汽车	18,578	66,880.80	0.18
259	601003	柳钢股份	10,160	66,751.20	0.18
260	300058	蓝色光标	15,374	66,723.16	0.18
261	002589	瑞康医药	9,571	66,709.87	0.18
262	601777	力帆股份	17,459	66,518.79	0.17
263	002450	康得新	8,694	66,422.16	0.17
264	002299	圣农发展	4,000	66,160.00	0.17
265	600491	龙元建设	9,735	65,905.95	0.17
266	002267	陕天然气	8,900	65,771.00	0.17
267	000921	海信科龙	9,262	65,482.34	0.17
268	000627	天茂集团	11,621	65,193.81	0.17
269	600481	双良节能	19,500	64,935.00	0.17
270	000887	中鼎股份	6,404	64,808.48	0.17
271	300027	华谊兄弟	13,724	64,365.56	0.17
272	600572	康恩贝	10,791	63,990.63	0.17
273	601789	宁波建工	20,477	63,478.70	0.17
274	600908	无锡银行	12,100	63,404.00	0.17
275	000418	小天鹅 A	1,464	63,318.00	0.17
276	002051	中工国际	5,669	62,812.52	0.16
277	002249	大洋电机	18,952	62,541.60	0.16
278	600869	智慧能源	12,845	62,298.25	0.16
279	600803	新奥股份	6,157	61,200.58	0.16
280	002050	三花智控	4,801	60,924.69	0.16
281	300017	网宿科技	7,698	60,275.34	0.16
282	600909	华安证券	12,757	60,213.04	0.16
283	002309	中利集团	7,156	59,681.04	0.16
284	002203	海亮股份	7,555	59,382.30	0.16
285	000717	韶钢松山	13,000	59,150.00	0.16

286	600516	方大炭素	3,523	58,869.33	0.15
287	002353	杰瑞股份	3,913	58,695.00	0.15
288	002466	天齐锂业	2,000	58,640.00	0.15
289	000826	启迪桑德	5,643	58,630.77	0.15
290	002271	东方雨虹	4,522	58,559.90	0.15
291	600648	外高桥	4,247	58,353.78	0.15
292	002013	中航机电	8,906	57,978.06	0.15
293	600508	上海能源	6,000	57,900.00	0.15
294	600216	浙江医药	6,619	57,452.92	0.15
295	601311	骆驼股份	6,505	57,439.15	0.15
296	600162	香江控股	26,300	57,334.00	0.15
297	601958	金钼股份	9,636	57,045.12	0.15
298	000536	华映科技	30,082	56,253.34	0.15
299	600295	鄂尔多斯	7,454	55,905.00	0.15
300	600686	金龙汽车	8,110	55,553.50	0.15
301	002399	海普瑞	2,400	55,320.00	0.15
302	002563	森马服饰	6,200	55,304.00	0.15
303	601101	昊华能源	9,200	55,292.00	0.15
304	600580	卧龙电气	8,768	55,238.40	0.14
305	002294	信立泰	2,631	54,961.59	0.14
306	000429	粤高速 A	6,500	54,535.00	0.14
307	002372	伟星新材	3,509	54,424.59	0.14
308	601566	九牧王	4,100	54,325.00	0.14
309	600267	海正药业	6,474	54,316.86	0.14
310	000078	海王生物	18,194	54,218.12	0.14
311	000828	东莞控股	7,252	54,172.44	0.14
312	002210	飞马国际	14,534	53,339.78	0.14
313	600509	天富能源	14,893	53,168.01	0.14

314	002572	索菲亚	3,161	52,946.75	0.14
315	000572	海马汽车	24,616	52,432.08	0.14
316	600884	杉杉股份	4,039	52,183.88	0.14
317	603885	吉祥航空	4,164	52,174.92	0.14
318	600278	东方创业	6,377	51,972.55	0.14
319	002426	胜利精密	22,400	51,968.00	0.14
320	002482	广田集团	8,896	51,507.84	0.14
321	300072	三聚环保	5,212	51,286.08	0.13
322	600062	华润双鹤	4,111	49,701.99	0.13
323	002739	万达电影	2,250	49,117.50	0.13
324	000513	丽珠集团	1,950	49,042.50	0.13
325	601021	春秋航空	1,537	48,891.97	0.13
326	000090	天健集团	10,594	48,732.40	0.13
327	601801	皖新传媒	7,196	48,069.28	0.13
328	002508	老板电器	2,363	47,708.97	0.13
329	600575	皖江物流	22,300	47,499.00	0.12
330	002032	苏泊尔	900	47,250.00	0.12
331	600428	中远海特	14,508	47,151.00	0.12
332	002251	步步高	6,243	46,323.06	0.12
333	600372	中航电子	3,550	46,079.00	0.12
334	601139	深圳燃气	8,580	46,074.60	0.12
335	002217	合力泰	9,765	45,700.20	0.12
336	601228	广州港	11,500	45,540.00	0.12
337	000030	富奥股份	12,180	45,187.80	0.12
338	002310	东方园林	6,300	43,848.00	0.12
339	600231	凌钢股份	16,388	43,755.96	0.11
340	002080	中材科技	5,351	43,289.59	0.11
341	000761	本钢板材	12,500	42,000.00	0.11

342	002662	京威股份	11,098	41,839.46	0.11
343	600240	华业资本	16,096	41,688.64	0.11
344	600012	皖通高速	6,900	41,607.00	0.11
345	002408	齐翔腾达	6,044	41,340.96	0.11
346	002344	海宁皮城	8,985	40,881.75	0.11
347	600525	长园集团	9,281	40,650.78	0.11
348	000759	中百集团	7,600	40,128.00	0.11
349	600751	海航科技	14,625	39,633.75	0.10
350	601163	三角轮胎	3,542	39,457.88	0.10
351	002429	兆驰股份	20,420	38,798.00	0.10
352	603328	依顿电子	3,900	38,610.00	0.10
353	000631	顺发恒业	13,000	38,610.00	0.10
354	600126	杭钢股份	8,535	38,492.85	0.10
355	000582	北部湾港	5,344	37,621.76	0.10
356	300433	蓝思科技	5,700	37,107.00	0.10
357	600566	济川药业	1,072	35,944.16	0.09
358	600809	山西汾酒	1,020	35,751.00	0.09
359	600180	瑞茂通	4,900	34,545.00	0.09
360	600390	五矿资本	4,900	34,104.00	0.09
361	603198	迎驾贡酒	2,408	33,976.88	0.09
362	601127	小康股份	1,960	33,594.40	0.09
363	000938	紫光股份	1,071	33,479.46	0.09
364	000666	经纬纺机	3,045	32,825.10	0.09
365	002302	西部建设	3,700	32,708.00	0.09
366	000869	张裕 A	1,200	31,200.00	0.08
367	603806	福斯特	1,149	30,793.20	0.08
368	601838	成都银行	3,800	30,590.00	0.08
369	000990	诚志股份	2,380	28,583.80	0.07

370	000537	广宇发展	3,800	28,462.00	0.07
371	000980	众泰汽车	6,400	27,712.00	0.07
372	000596	古井贡酒	499	26,926.04	0.07
373	601828	美凯龙	2,400	26,496.00	0.07
374	600754	锦江股份	1,216	25,900.80	0.07
375	600682	南京新百	2,873	25,224.94	0.07
376	603225	新凤鸣	1,300	24,375.00	0.06
377	002252	上海莱士	3,042	24,366.42	0.06
378	000793	华闻传媒	8,000	23,760.00	0.06
379	000587	金洲慈航	9,830	23,100.50	0.06
380	600346	恒力股份	1,700	22,525.00	0.06
381	000553	沙隆达 A	2,300	20,999.00	0.06
382	000987	越秀金控	2,561	20,411.17	0.05
383	600828	茂业商业	4,200	19,698.00	0.05
384	601326	秦港股份	5,500	17,270.00	0.05
385	601019	山东出版	2,200	17,204.00	0.05
386	601108	财通证券	2,300	16,606.00	0.04
387	600233	圆通速递	1,466	14,660.00	0.04
388	601878	浙商证券	1,900	13,794.00	0.04
389	603056	德邦股份	600	9,930.00	0.03
390	002010	传化智联	1,300	8,450.00	0.02
391	000723	美锦能源	2,000	6,420.00	0.02
392	601360	三六零	300	6,111.00	0.02

### 8.3.2 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	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------



1	600485	信威集团	4,762	69,477.58	0.18
---	--------	------	-------	-----------	------

注：积极投资股票为停牌等原因造成的被动持有非当前成分股。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	000878	云南铜业	281,059.00	0.50
2	600875	东方电气	267,537.00	0.47
3	000059	华锦股份	266,340.00	0.47
4	000425	徐工机械	256,445.00	0.45
5	600266	北京城建	247,968.00	0.44
6	600489	中金黄金	216,580.00	0.38
7	600348	阳泉煤业	215,156.00	0.38
8	000703	恒逸石化	214,254.00	0.38
9	600694	大商股份	201,203.00	0.35
10	600649	城投控股	188,375.00	0.33
11	600157	永泰能源	186,660.00	0.33
12	601699	潞安环能	181,608.00	0.32
13	000600	建投能源	169,675.00	0.30
14	601179	中国西电	169,454.00	0.30
15	000550	江铃汽车	167,403.00	0.29
16	300226	上海钢联	160,767.00	0.28
17	000792	盐湖股份	150,060.00	0.26
18	600269	赣粤高速	146,395.00	0.26
19	000413	东旭光电	143,280.00	0.25
20	603858	步长制药	140,532.00	0.25

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**8.4.2 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	000830	鲁西化工	433,585.47	0.76
2	600596	新安股份	297,668.00	0.52
3	600703	三安光电	275,922.77	0.49
4	600705	中航资本	254,299.26	0.45
5	600406	国电南瑞	242,455.58	0.43
6	600729	重庆百货	223,859.20	0.39
7	002422	科伦药业	222,080.00	0.39
8	600276	恒瑞医药	220,248.47	0.39
9	000878	云南铜业	220,144.00	0.39
10	600315	上海家化	214,237.80	0.38
11	601233	桐昆股份	211,002.00	0.37
12	600867	通化东宝	182,591.86	0.32
13	002230	科大讯飞	173,140.71	0.30
14	600782	新钢股份	167,993.40	0.30
15	600369	西南证券	164,798.79	0.29
16	300003	乐普医疗	161,041.36	0.28
17	000690	宝新能源	158,769.30	0.28
18	002081	金螳螂	154,505.13	0.27
19	600004	白云机场	144,119.00	0.25
20	002027	分众传媒	143,796.18	0.25

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**8.4.3 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	12,597,374.82
卖出股票收入（成交）总额	14,937,894.78

注：本项“买入股票成本”、“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。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

## 8.6 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

报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

## 8.8 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

报告期末本基金未投资贵金属。

## 8.9 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

本报告期末本基金未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**8.12.3 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	428.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	648.76
5	应收申购款	3,795.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,872.77

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

报告期末本基金投资前十名股票中无流通受限情况。

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	69,477.58	0.18	重大事项

注：积极投资股票为停牌等原因造成的被动持有非当前成分股。

**8.12.6 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。**

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰信基本面 400A	53	17,081.19	0.00	0.00%	905,303.00	100.00%
泰信基本面 400B	381	2,376.12	108.00	0.01%	905,195.00	99.99%
泰信基本面 400	539	81,782.50	34,011,199.72	77.16%	10,069,568.12	22.84%
合计	973	47,164.82	34,011,307.72	74.11%	11,880,066.12	25.89%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

泰信基本面 400A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	谢孟春	242,821.00	26.82%
2	张殿刚	122,800.00	13.56%
3	吴益群	84,860.00	9.37%
4	余志胜	81,350.00	8.99%
5	张蓉	55,592.00	6.14%
6	黄英	54,900.00	6.06%
7	张鹏	54,567.00	6.03%
8	刘辉荣	53,900.00	5.95%
9	吕谷城	42,400.00	4.68%
10	沈月海	29,600.00	3.27%

## 泰信基本面 400B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	韩莉颖	214,020.00	23.64%
2	马宏贵	80,733.00	8.92%
3	吉庆伍	38,094.00	4.21%
4	张仁仓	27,103.00	2.99%
5	崔文涛	22,428.00	2.48%
6	王方	19,539.00	2.16%
7	孙丽君	16,713.00	1.85%
8	杨一木	15,943.00	1.76%
9	包素芹	15,700.00	1.73%
10	张敏红	15,484.00	1.71%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 9.4 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰信基本面 400A	0
	泰信基本面 400B	0
	泰信基本面 400	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰信基本面 400A	0
	泰信基本面 400B	0
	泰信基本面 400	0
	合计	0

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
基金合同生效日（2012 年 9 月 7 日） 基金份额总额	-	-	300,843,720.90
本报告期期初基金份额总额	3,736,353.00	3,736,353.00	67,828,585.40
本报告期间基金总申购份额	-	-	2,210,978.13
减:本报告期间基金总赎回份额	-	-	4,946,150.31
本报告期间基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-2,831,050.00	-2,831,050.00	-21,012,645.38
本报告期期末基金份额总额	905,303.00	905,303.00	44,080,767.84

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币 6 万元。该审计机构从基金合同生效日（2012 年 9 月 7 日）开始为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
川财证券	1	15,114,207.75	55.06%	14,076.12	55.59%	-
中国银河证	1	12,310,058.32	44.84%	11,218.31	44.31%	-



券						
广发证券	2	27,048.00	0.10%	24.65	0.10%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对交易单元租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本报告期新增交易单元：新时代证券上海 41828；国盛证券深圳 006813；退租交易单元：瑞银证券深圳 390981。

### 11.7.2 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
川财证券	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	办理定期份额折算期间泰信 400A 份额停复牌公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 1 月 3 日
2	第七个运作周期约定收益率公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 1 月 3 日
3	新增盈米财富为销售机构并开通转换定投及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 1 月 4 日
4	定期折算结果及恢复交易公告、泰信 400A 前收盘价调整公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 1 月 4 日
5	停牌股票估值调整（冀东水泥）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 1 月 9 日
6	在嘉实基金开通费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 1 月 19 日
7	17 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 1 月 19 日
8	在大泰金石、中泰证券开通申购、	《中国证券报》、《上海证券	2018 年 1 月 30 日

	定投费率优惠	报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
9	新增上海基煜基金为销售机构并开通转换、定投及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 1 月 31 日
10	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 7 日
11	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 7 日
12	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 8 日
13	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 9 日
14	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 10 日
15	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 13 日

		报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
16	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 14 日
17	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 22 日
18	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 24 日
19	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 27 日
20	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 2 月 28 日
21	17 年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 3 月 29 日
22	东海证券、工商银行费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站	2018 年 3 月 30 日

		(www.ftfund.com)	
23	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 3 月 30 日
24	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 4 日
25	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 9 日
26	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 10 日
27	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 13 日
28	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 14 日
29	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 17 日

30	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 18 日
31	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 19 日
32	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 21 日
33	2018 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 21 日
34	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 24 日
35	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 25 日
36	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 4 月 26 日
37	可能发生不定期折算业务公告、B	《中国证券报》、《上海证券	2018 年 4 月 27 日

	类份额交易价格波动风险提示公告	报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
38	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018年4月28日
39	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018年5月3日
40	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018年5月4日
41	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018年5月5日
42	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018年5月8日
43	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018年5月9日
44	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018年5月10日



		报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
45	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 11 日
46	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 12 日
47	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 15 日
48	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 16 日
49	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 17 日
50	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 18 日
51	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站	2018 年 5 月 19 日

		(www.ftfund.com)	
52	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 24 日
53	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 25 日
54	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 26 日
55	新增济安财富（北京）基金为销售机构并开通转换定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 26 日
56	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 29 日
57	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 30 日
58	参加银河证券申购定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 30 日

59	新增天津国美基金销售有限公司为销售机构并开通转换及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 30 日
60	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 5 月 31 日
61	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 1 日
62	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 2 日
63	可能发生不定期折算业务公告、B 类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 5 日
64	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 6 日
65	参加华宝证券费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 6 日
66	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券	2018 年 6 月 7 日

		报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
67	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 8 日
68	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 9 日
69	在国金证券开通转换定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 13 日
70	旗下基金终止懒猫金服销售业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 20 日
71	不定期折算公告（下折）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 20 日
72	不定期折算 B 类份额风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 20 日
73	不定期折算折算基准日 B 类份额证券简称调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 20 日

		报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
74	400B 份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 21 日
75	不定期折算期间泰信 400A、泰信 400B 停复牌公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 21 日
76	不定期份额折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 22 日
77	不定期折算后复牌首日泰信 400A、泰信 400B 前收盘价调整公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 6 月 22 日
78	18 年 2 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 7 月 20 日
79	南京苏宁基金开通转换定投及费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 8 月 1 日
80	停牌股票估值调整（万达信息）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站	2018 年 8 月 7 日

		(www.ftfund.com)	
81	新增麟龙投资顾问为销售机构并开通定投转换及费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 8 月 15 日
82	在中金公司开通定投业务并参加费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 8 月 21 日
83	2018 年半年报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 8 月 25 日
84	在东海证券开通转换及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 9 月 6 日
85	停牌股票估值调整（康得新）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 10 月 12 日
86	18 年 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 10 月 26 日
87	华福证券费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 11 月 17 日

88	参加工商银行定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 12 月 25 日
89	办理定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 12 月 26 日
90	参加工商银行定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2018 年 12 月 25 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20180101-20181231	29,104,230.83	981,431.85	11,450,906.85	18,634,755.83	40.61%
	2	20180101-20181231	24,010,861.29	809,676.94	9,446,947.34	15,373,590.89	33.50%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。



## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

### 13.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人住所、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

### 13.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站([www.ftfund.com](http://www.ftfund.com))查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988, 021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日