

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券 投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 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 8 月 24 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。本半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 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.4 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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64

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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 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	45,948,141.02 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	1,063,479.00 份	1,063,479.00 份	43,821,183.02 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%×中证锐联基本面 400 指数收益率+5%×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	陈四清

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	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
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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-2,761,873.66
本期利润	6,932,648.74
加权平均基金份额本期利润	0.1497
本期加权平均净值利润率	15.47%
本期基金份额净值增长率	17.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	13,349,715.62
期末可供分配基金份额利润	0.2905
期末基金资产净值	44,296,030.97
期末基金份额净值	0.964
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	42.94%

- 1、本基金基金合同于 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
过去一个月	0.73%	1.25%	0.61%	1.28%	0.12%	-0.03%
过去三个月	-8.80%	1.67%	-9.55%	1.70%	0.75%	-0.03%
过去六个月	17.85%	1.64%	18.69%	1.68%	-0.84%	-0.04%
过去一年	-1.77%	1.55%	-1.10%	1.58%	-0.67%	-0.03%
过去三年	-10.43%	1.21%	-6.51%	1.23%	-3.92%	-0.02%
自基金合同生效起至今	42.94%	1.63%	59.03%	1.66%	-16.09%	-0.03%

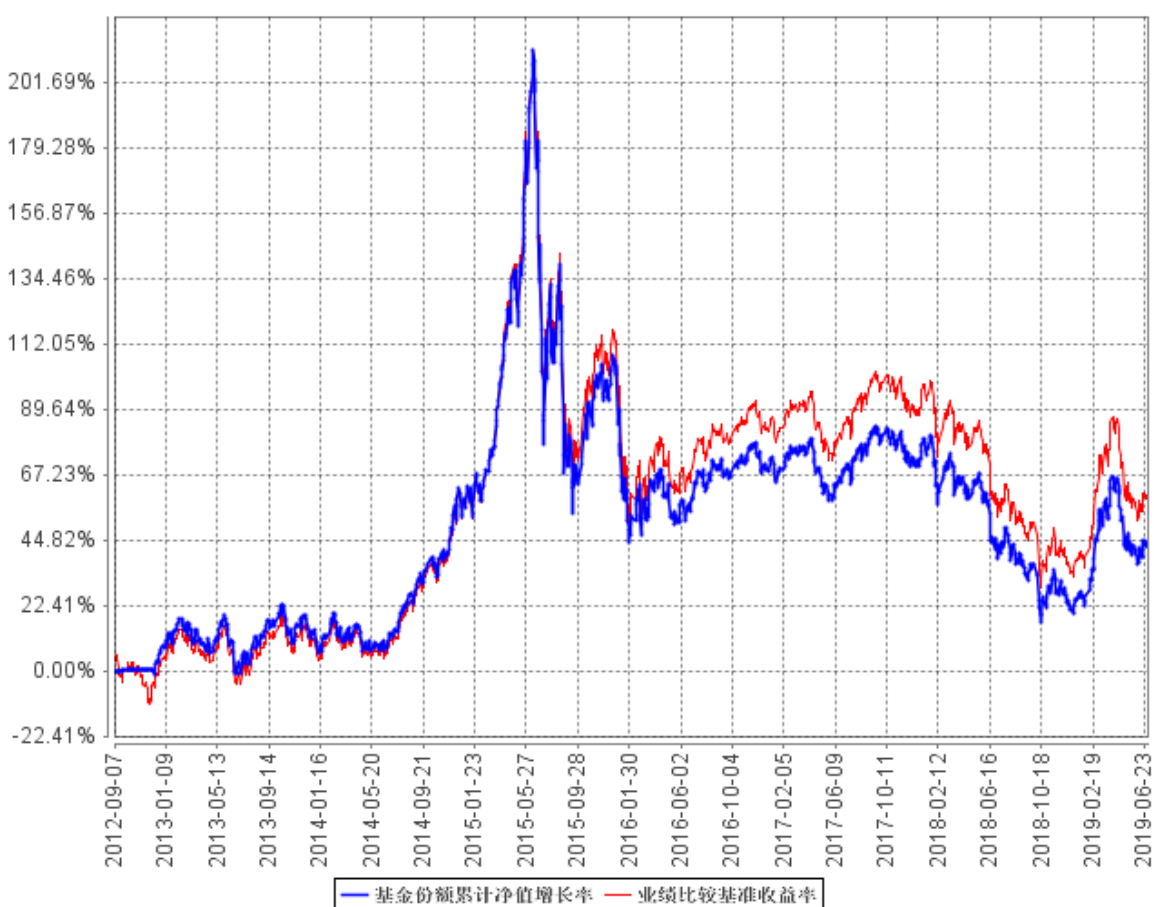
本基金业绩比较基准为：95%×中证锐联基本面 400 指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率

率（税后）

中证锐联基本面 400 指数以沪深 A 股为样本空间，挑选基本面价值中间的第 201 家至第 600 家上市公司作为样本股，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



- 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%。

§ 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 2019 年 6 月底，公司有正式员工 97 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 2019 年 6 月 30 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、泰信竞争优选共 21 只开放式基金及 14 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	-	13 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。

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》、《泰信中证锐利基本面 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。

4.3.2 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，亦无其他异常交易行为。

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

2019 年上半年全球经济疲软将迫使全球央行货币政策由紧转松提速，推动全球风险偏好回暖，而国内资本市场顶层政策定位提升也较大修复了投资者 18 年以来低迷情绪，但是中美贸易战一波三折不断反复，也导致市场先扬后抑，上半年上证综指上涨 19.45%，中小板上涨 203.75%，创业板上涨 20.87%。

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 1.2%。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 0.964 元；本报告期基金份额净值增长率为 17.85%，业绩比较基准收益率为 18.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济共振下行仍然是预期之内的风险，中美两国通胀的高位回落也会大概率发生，这为全球货币政策的进一步宽松打开了窗口。美国经济产出缺口由正转负并进一步扩大，将对美元指数构成阶段性压力。库存周期寻底之旅决定 A 股趋势，流动性宽松有望带来结构性反弹行情。

展望下半年，基数效应有望为 A 股全年盈利水平带来正贡献，量价下行压力下营收企稳仍存在较大压力。下半年市场或仍将经历基本面数据及中美贸易走势的不确定性带来的阶段性风险偏好冲击，市场机会或来自于估值回落后内部对冲政策的释放带来的风险偏好抬升以及系统性风险释放后，部分逆周期行业盈利触底回升带来的估值修复机会。

从长期大国博弈的角度看，经济长期竞争力将决定资本市场的大趋势。中国保持战略定力，

坚持供给侧改革和改革开放，经济转型高质量发展将利在长远。中国的调结构将带来核心资产的重估。科创板赋予了资本市场重新定位，长期来看中国的权益市场迎来战略新机遇。

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：

王译晨女士，硕士。2019 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部总监助理。

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。

4.7 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。

4.8 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

本报告期本基金于 2019 年 1 月 2 日至 2019 年 3 月 29 日、2019 年 4 月 25 日至 2019 年 6 月 28 日有连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。我公司已向中国证监会报送泰信基本面 400 指数分级基金申请转型解决方案。

§ 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 托管人对本半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 2019 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,131,621.41	3,258,492.88
结算备付金		-	-
存出保证金		244.06	428.57
交易性金融资产	6.4.7.2	40,332,780.76	35,087,668.86
其中：股票投资		40,332,780.76	35,087,668.86
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	729.15	648.76
应收股利		-	-
应收申购款		499.40	3,795.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		44,465,874.78	38,351,034.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		35,877.07	33,545.18
应付托管费		7,892.95	7,379.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	31,051.39	322.76
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	95,022.40	190,030.19
负债合计		169,843.81	231,278.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	30,946,315.35	31,408,921.19
未分配利润	6.4.7.10	13,349,715.62	6,710,835.24
所有者权益合计		44,296,030.97	38,119,756.43
负债和所有者权益总计		44,465,874.78	38,351,034.51

报告截止日 2019 年 6 月 30 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 0.964 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额净值 1.024 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额净值 0.904 元；基金份额总额 45,948,141.02 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 43,821,183.02 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 1,063,479.00 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 1,063,479.00 份。

6.2 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		7,369,227.28	-8,135,980.58
1.利息收入		11,532.95	12,357.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,532.95	12,357.95
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）		-2,339,934.02	467,917.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,870,005.73	-21,625.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
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	530,071.71	489,542.70
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.17	9,694,522.40	-8,621,753.44

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	3,105.95	5,497.74
减:二、费用		436,578.54	521,842.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	221,358.39	267,060.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	48,698.84	58,753.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	51,716.02	41,088.54
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	114,805.29	154,940.18
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		6,932,648.74	-8,657,823.13
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		6,932,648.74	-8,657,823.13

6.3 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: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	31,408,921.19	6,710,835.24	38,119,756.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,932,648.74	6,932,648.74
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)	-462,605.84	-293,768.36	-756,374.20
其中: 1.基金申购款	825,316.41	402,930.71	1,228,247.12
2. 基金赎回款	-1,287,922.25	-696,699.07	-1,984,621.32
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）	30,946,315.35	13,349,715.62	44,296,030.97
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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）	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）	-	-8,657,823.13	-8,657,823.13
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）	-1,909,011.12	-946,106.37	-2,855,117.49
其中：1.基金申购款	574,926.55	306,398.43	881,324.98
2.基金赎回款	-2,483,937.67	-1,252,504.80	-3,736,442.47
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）	31,088,966.76	14,176,418.57	45,265,385.33

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：

<u>葛航</u>	<u>韩波</u>	<u>蔡海成</u>
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)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年半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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	4,131,621.41
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：	4,131,621.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	46,303,119.01	40,332,780.76	-5,970,338.25
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	46,303,119.01	40,332,780.76	-5,970,338.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	729.06
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	-
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	0.09
合计	729.15

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	31,051.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	31,051.39

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	83,463.42
应付指数使用费	11,558.98
合计	95,022.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	45,891,373.84	31,408,921.19
本期申购	2,163.46	1,481.11
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
2019年1月2日 基金拆分/份额 折算前	45,893,537.30	31,410,402.30
基金拆分/份额折算变动份额	743,846.49	-
本期申购	1,223,145.18	823,835.30
本期赎回(以“-”号填列)	-1,912,387.95	-1,287,922.25
本期末	45,948,141.02	30,946,315.35

(1) 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所(以下简称“深交所”)和中国证券

登记结算有限责任公司的规定，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 的基础份额以及泰信基本面 400A 份额实施定期份额折算。

(2) 根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回泰信基本面 400 份额，泰信基本面 400A 和泰信基本面 400B 份额只可深圳交易所上市交易，因此上表不再单独披露泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的情况。

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	19,824,436.14	-13,113,600.90	6,710,835.24
本期利润	-2,761,873.66	9,694,522.40	6,932,648.74
本期基金份额交易产生的变动数	-287,696.41	-6,071.95	-293,768.36
其中：基金申购款	514,542.56	-111,611.85	402,930.71
基金赎回款	-802,238.97	105,539.90	-696,699.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,774,866.07	-3,425,150.45	13,349,715.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,530.43
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	1.30
其他	1.22
合计	11,532.95

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	17,821,801.01
减：卖出股票成本总额	20,691,806.74

买卖股票差价收入	-2,870,005.73
----------	---------------

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期本基金无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	530,071.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	530,071.71

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	9,694,522.40
——股票投资	9,694,522.40
——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	9,694,522.40
----	--------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	3,105.95
合计	3,105.95

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%，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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	51,716.02
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	51,716.02

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	23,957.86
债券账户维护费——中债登	9,000.00
指数使用费	22,135.87
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	206.00
债券账户维护费——上清所	-
合计	114,805.29

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本报告期无需要说明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

本报告期本基金控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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（“青岛国信”）	基金管理人的股东

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

本基金本报告期及上年度可比期间未进行关联交易。

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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	221,358.39	267,060.52
其中：支付销售机构的客户维护费	25,832.08	28,838.45

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 1.0% 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 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	48,698.84	58,753.31

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间未发生销售服务费用。

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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	-	-	15,373,590.89
期间申购/买入总份额	-	-	0.00
期间因拆分变动份额	-	-	249,176.89
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	300,000.00
期末持有的基金份额	-	-	15,322,767.78
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	33.3500%

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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	-	-	0.00
期间因拆分变动份额	-	-	-8,637,270.40
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	0.00
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	-	-	33.8400%

1、依据《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》相关约定，持有时间 2 年以上（含 2 年）不收取赎回费用。

2、基金管理人泰信基金管理有限公司在本期赎回本基金的交易委托泰信直销办理。

6.4.10.4.2 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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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
山东省国际信托股份有限公司	18,936,790.03	41.2100%	18,634,755.83	40.6100%

6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国工商银行	4,131,621.41	11,530.43	4,635,337.93	11,754.52

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 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。

6.4.12 期末（2019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**

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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
600485	*ST信威	2016年12月26日	重大事项	6.28	2019年7月12日	13.86	4,762	88,204.18	29,905.36	-

6.4.12.3 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

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。

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 2019 年 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上

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%。于 2019 年 6 月 30 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 0.07%。

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 2019 年 6 月 30 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 44,434,496.810 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。

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和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	4,131,621.41	-	-	-	4,131,621.41
存出保证金	244.06	-	-	-	244.06
交易性金融资产	-	-	-	40,332,780.76	40,332,780.76
应收利息	-	-	-	729.15	729.15
应收申购款	-	-	-	499.40	499.40
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,131,865.47	-	-	40,334,009.31	44,465,874.78
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	35,877.07	35,877.07
应付托管费	-	-	-	7,892.95	7,892.95
应付交易费用	-	-	-	31,051.39	31,051.39
其他负债	-	-	-	95,022.40	95,022.40
负债总计	-	-	-	169,843.81	169,843.81
利率敏感度缺口	4,131,865.47	-	-	40,164,165.50	44,296,030.97
上年度末 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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 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（2018 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，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。

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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	40,332,780.76	91.05	35,087,668.86	92.05
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	40,332,780.76	91.05	35,087,668.86	92.05

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		
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 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,636,667.95	1,891,632.38
2. 业绩比较基准下降 5%	-2,636,667.95	-1,891,632.38	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	40,332,780.76	90.71
	其中：股票	40,332,780.76	90.71
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	4,131,621.41	9.29
8	其他各项资产	1,472.61	0.00
9	合计	44,465,874.78	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	232,432.85	0.52
B	采矿业	1,989,400.05	4.49
C	制造业	22,472,452.73	50.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	925,210.02	2.09
E	建筑业	1,306,215.73	2.95
F	批发和零售业	3,119,904.60	7.04
G	交通运输、仓储和邮政业	2,157,944.12	4.87
H	住宿和餐饮业	61,994.24	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,201,877.47	2.71
J	金融业	2,645,067.59	5.97
K	房地产业	2,544,507.48	5.74
L	租赁和商务服务业	724,178.70	1.63
M	科学研究和技术服务业	17,336.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	248,738.07	0.56

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	55,746.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	599,869.75	1.35
S	综合	-	-
	合计	40,302,875.40	90.99

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,905.36	0.07
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	29,905.36	0.07

积极投资股票为被动持有非当前成分股，将逐步进行调整成分股。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票。

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	占基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	3,917	258,522.00	0.58
2	000413	东旭光电	49,603	254,959.42	0.58
3	000039	中集集团	23,280	248,630.40	0.56
4	600109	国金证券	25,478	247,646.16	0.56
5	600100	同方股份	26,800	242,540.00	0.55
6	601233	桐昆股份	15,559	241,320.09	0.54
7	000488	晨鸣纸业	44,550	238,788.00	0.54
8	600418	江淮汽车	45,700	235,812.00	0.53
9	600522	中天科技	25,587	234,632.79	0.53
10	002183	怡亚通	46,183	220,292.91	0.50
11	601555	东吴证券	21,234	217,648.50	0.49
12	600325	华发股份	27,398	213,978.38	0.48
13	000425	徐工机械	47,704	212,759.84	0.48
14	600664	哈药股份	48,700	201,618.00	0.46
15	600739	辽宁成大	13,841	201,248.14	0.45
16	600516	方大炭素	16,275	200,019.75	0.45
17	600166	福田汽车	84,300	199,791.00	0.45
18	601333	广深铁路	61,300	197,999.00	0.45
19	600873	梅花生物	41,176	197,233.04	0.45
20	600528	中铁工业	16,800	194,376.00	0.44
21	000066	中国长城	18,600	191,208.00	0.43
22	002241	歌尔股份	21,400	190,246.00	0.43
23	600881	亚泰集团	58,352	189,644.00	0.43
24	600584	长电科技	14,633	188,034.05	0.42
25	000963	华东医药	7,184	186,496.64	0.42
26	000059	华锦股份	28,828	184,499.20	0.42
27	002081	金螳螂	17,867	184,208.77	0.42
28	000728	国元证券	20,036	183,730.12	0.41
29	600804	鹏博士	24,408	183,548.16	0.41
30	000623	吉林敖东	11,127	182,371.53	0.41
31	600039	四川路桥	49,829	181,377.56	0.41
32	000423	东阿阿胶	4,543	180,902.26	0.41
33	600266	北京城建	22,271	179,504.26	0.41

34	000830	鲁西化工	16,311	177,463.68	0.40
35	600487	亨通光电	10,586	177,421.36	0.40
36	600489	中金黄金	17,169	176,325.63	0.40
37	600138	中青旅	13,817	175,337.73	0.40
38	600157	永泰能源	104,169	175,003.92	0.40
39	601901	方正证券	24,600	174,906.00	0.39
40	000878	云南铜业	16,200	172,206.00	0.39
41	600507	方大特钢	17,436	170,524.08	0.38
42	000581	威孚高科	9,182	170,417.92	0.38
43	600348	阳泉煤业	29,305	170,262.05	0.38
44	600176	中国巨石	17,841	170,024.73	0.38
45	601012	隆基股份	7,356	169,997.16	0.38
46	600535	天士力	10,268	169,935.40	0.38
47	002236	大华股份	11,650	169,158.00	0.38
48	601168	西部矿业	26,361	168,183.18	0.38
49	300226	上海钢联	2,235	167,535.60	0.38
50	600426	华鲁恒升	11,259	167,308.74	0.38
51	002475	立讯精密	6,744	167,183.76	0.38
52	000401	冀东水泥	9,476	166,872.36	0.38
53	002001	新和成	8,623	166,337.67	0.38
54	601108	财通证券	14,800	162,504.00	0.37
55	000983	西山煤电	26,800	162,408.00	0.37
56	002078	太阳纸业	23,777	161,921.37	0.37
57	000701	厦门信达	26,292	161,432.88	0.36
58	600143	金发科技	32,865	161,038.50	0.36
59	600567	山鹰纸业	46,747	157,537.39	0.36
60	600004	白云机场	8,607	156,647.40	0.35
61	600717	天津港	24,240	155,620.80	0.35
62	002456	欧菲光	19,778	155,059.52	0.35
63	600729	重庆百货	5,093	154,012.32	0.35
64	600409	三友化工	27,125	153,527.50	0.35
65	600307	酒钢宏兴	75,400	153,062.00	0.35
66	603858	步长制药	5,900	152,043.00	0.34
67	600546	山煤国际	27,800	149,564.00	0.34
68	002311	海大集团	4,806	148,505.40	0.34
69	600369	西南证券	30,000	148,200.00	0.33
70	600816	安信信托	29,130	147,106.50	0.33
71	000926	福星股份	21,117	146,129.64	0.33
72	000060	中金岭南	30,810	144,498.90	0.33

73	601718	际华集团	36,793	143,860.63	0.32
74	002221	东华能源	16,692	143,718.12	0.32
75	002589	瑞康医药	18,907	143,504.13	0.32
76	000960	锡业股份	12,729	142,182.93	0.32
77	000543	皖能电力	29,876	140,715.96	0.32
78	600699	均胜电子	6,552	139,950.72	0.32
79	600438	通威股份	9,952	139,925.12	0.32
80	000768	中航飞机	8,874	139,765.50	0.32
81	002004	华邦健康	28,701	139,486.86	0.31
82	300070	碧水源	17,790	138,584.10	0.31
83	600332	白云山	3,381	138,519.57	0.31
84	000050	深天马 A	10,230	137,491.20	0.31
85	002244	滨江集团	32,776	136,020.40	0.31
86	600694	大商股份	4,858	135,586.78	0.31
87	600649	城投控股	20,885	135,125.95	0.31
88	000961	中南建设	15,600	135,096.00	0.30
89	600056	中国医药	9,934	134,009.66	0.30
90	600811	东方集团	35,979	133,841.88	0.30
91	601699	潞安环能	16,818	133,534.92	0.30
92	002422	科伦药业	4,482	133,249.86	0.30
93	000750	国海证券	26,225	131,911.75	0.30
94	600079	人福医药	12,474	130,977.00	0.30
95	600875	东方电气	12,326	130,902.12	0.30
96	000786	北新建材	7,151	129,647.63	0.29
97	002008	大族激光	3,763	129,371.94	0.29
98	600466	蓝光发展	20,668	128,554.96	0.29
99	600498	烽火通信	4,607	128,351.02	0.29
100	002385	大北农	24,229	128,171.41	0.29
101	000600	建投能源	18,900	126,630.00	0.29
102	600312	平高电气	16,305	125,385.45	0.28
103	000732	泰禾集团	7,558	124,707.00	0.28
104	600859	王府井	8,207	124,664.33	0.28
105	600970	中材国际	19,377	124,594.11	0.28
106	600256	广汇能源	34,834	124,009.04	0.28
107	601198	东兴证券	10,427	123,872.76	0.28
108	601098	中南传媒	9,745	123,176.80	0.28
109	600026	中远海能	18,918	122,777.82	0.28
110	601000	唐山港	44,524	122,441.00	0.28
111	002233	塔牌集团	10,440	121,939.20	0.28

112	600801	华新水泥	6,019	121,884.75	0.28
113	601179	中国西电	32,423	119,965.10	0.27
114	300059	东方财富	8,813	119,416.15	0.27
115	000686	东北证券	13,491	118,855.71	0.27
116	600708	光明地产	21,278	118,731.24	0.27
117	600482	中国动力	4,992	117,911.04	0.27
118	600252	中恒集团	40,102	117,498.86	0.27
119	600597	光明乳业	10,791	116,003.25	0.26
120	600183	生益科技	7,681	115,599.05	0.26
121	000829	天音控股	19,856	115,561.92	0.26
122	603156	养元饮品	3,100	114,948.00	0.26
123	600959	江苏有线	25,796	114,792.20	0.26
124	600380	健康元	13,258	114,681.70	0.26
125	600600	青岛啤酒	2,276	113,640.68	0.26
126	601216	君正集团	34,536	113,623.44	0.26
127	000977	浪潮信息	4,762	113,621.32	0.26
128	600160	巨化股份	15,775	112,160.25	0.25
129	600037	歌华有线	10,927	112,001.75	0.25
130	002237	恒邦股份	6,694	111,856.74	0.25
131	600269	赣粤高速	25,186	111,825.84	0.25
132	000690	宝新能源	17,247	111,070.68	0.25
133	600497	驰宏锌锗	21,861	111,053.88	0.25
134	601588	北辰实业	29,549	110,808.75	0.25
135	600141	兴发集团	10,755	110,561.40	0.25
136	000627	天茂集团	17,021	110,466.29	0.25
137	600096	云天化	18,519	110,373.24	0.25
138	000826	启迪桑德	9,343	110,153.97	0.25
139	601666	平煤股份	26,349	110,138.82	0.25
140	600415	小商品城	26,709	110,041.08	0.25
141	002294	信立泰	4,894	109,527.72	0.25
142	002091	江苏国泰	19,171	109,466.41	0.25
143	000800	一汽轿车	11,044	108,672.96	0.25
144	601636	旗滨集团	27,936	108,671.04	0.25
145	600373	中文传媒	8,650	108,644.00	0.25
146	002048	宁波华翔	9,981	107,994.42	0.24
147	002440	闰土股份	8,631	107,542.26	0.24
148	300146	汤臣倍健	5,510	106,894.00	0.24
149	600835	上海机电	6,380	105,908.00	0.24
150	000034	神州数码	8,200	105,780.00	0.24

151	600502	安徽水利	22,748	105,778.20	0.24
152	601128	常熟银行	13,641	105,308.52	0.24
153	002340	格林美	22,300	105,033.00	0.24
154	600308	华泰股份	23,500	104,810.00	0.24
155	600879	航天电子	17,011	104,787.76	0.24
156	000528	柳工	15,674	104,388.84	0.24
157	600655	豫园股份	12,729	104,250.51	0.24
158	600320	振华重工	27,555	103,606.80	0.23
159	601872	招商轮船	23,677	103,231.72	0.23
160	600978	宜华生活	27,426	103,121.76	0.23
161	600663	陆家嘴	6,648	103,044.00	0.23
162	000860	顺鑫农业	2,207	102,956.55	0.23
163	000559	万向钱潮	17,063	102,036.74	0.23
164	600742	一汽富维	9,553	101,930.51	0.23
165	000028	国药一致	2,430	101,646.90	0.23
166	002673	西部证券	10,066	101,465.28	0.23
167	002500	山西证券	12,476	101,055.60	0.23
168	600008	首创股份	28,457	100,168.64	0.23
169	601866	中远海发	36,754	99,970.88	0.23
170	000729	燕京啤酒	15,044	99,892.16	0.23
171	600122	宏图高科	31,083	99,776.43	0.23
172	300124	汇川技术	4,340	99,429.40	0.22
173	002416	爱施德	15,867	99,168.75	0.22
174	000090	天健集团	19,976	98,681.44	0.22
175	002470	金正大	27,093	98,618.52	0.22
176	600981	汇鸿集团	20,500	98,605.00	0.22
177	600515	海航基础	19,900	98,505.00	0.22
178	600339	中油工程	23,300	98,326.00	0.22
179	000501	鄂武商 A	9,138	98,233.50	0.22
180	002128	露天煤业	11,338	98,073.70	0.22
181	000513	丽珠集团	2,950	98,028.50	0.22
182	000900	现代投资	21,000	97,860.00	0.22
183	000685	中山公用	11,380	97,185.20	0.22
184	300072	三聚环保	12,182	96,603.26	0.22
185	600582	天地科技	27,951	96,430.95	0.22
186	000012	南玻 A	23,173	96,399.68	0.22
187	600064	南京高科	8,965	96,015.15	0.22
188	600572	康恩贝	14,991	95,942.40	0.22
189	600085	同仁堂	3,305	95,845.00	0.22

190	002572	索菲亚	5,161	95,788.16	0.22
191	601058	赛轮轮胎	32,233	95,732.01	0.22
192	601678	滨化股份	14,135	95,552.60	0.22
193	002419	天虹股份	7,313	95,507.78	0.22
194	601611	中国核建	12,272	95,476.16	0.22
195	000718	苏宁环球	27,532	95,260.72	0.22
196	000016	深康佳 A	22,641	95,092.20	0.21
197	000917	电广传媒	13,493	94,855.79	0.21
198	000933	神火股份	22,528	94,842.88	0.21
199	600549	厦门钨业	6,599	94,431.69	0.21
200	002701	奥瑞金	20,211	94,385.37	0.21
201	002601	龙蟠佰利	6,347	94,126.01	0.21
202	000683	远兴能源	36,035	94,051.35	0.21
203	000951	中国重汽	5,851	93,908.55	0.21
204	000999	华润三九	3,189	93,565.26	0.21
205	000726	鲁泰 A	9,748	93,190.88	0.21
206	603766	隆鑫通用	22,173	92,904.87	0.21
207	600210	紫江企业	22,938	92,898.90	0.21
208	000078	海王生物	26,694	92,895.12	0.21
209	002085	万丰奥威	12,718	92,587.04	0.21
210	600682	南京新百	8,173	92,436.63	0.21
211	600291	西水股份	9,164	92,189.84	0.21
212	000887	中鼎股份	9,609	92,150.31	0.21
213	000921	海信家电	7,375	92,040.00	0.21
214	600277	亿利洁能	18,819	91,648.53	0.21
215	002271	东方雨虹	4,044	91,637.04	0.21
216	300017	网宿科技	8,498	91,608.44	0.21
217	002714	牧原股份	1,556	91,477.24	0.21
218	002926	华西证券	8,700	91,350.00	0.21
219	002508	老板电器	3,363	91,271.82	0.21
220	002065	东华软件	13,035	91,114.65	0.21
221	002563	森马服饰	8,228	91,001.68	0.21
222	002050	三花智控	8,610	90,835.50	0.21
223	600612	老凤祥	2,032	90,830.40	0.21
224	000591	太阳能	27,600	90,528.00	0.20
225	300058	蓝色光标	21,174	90,412.98	0.20
226	002466	天齐锂业	3,572	90,300.16	0.20
227	000807	云铝股份	19,204	90,066.76	0.20
228	300408	三环集团	4,608	89,625.60	0.20

229	600623	华谊集团	11,705	89,426.20	0.20
230	600511	国药股份	3,884	89,215.48	0.20
231	600718	东软集团	6,954	89,150.28	0.20
232	000758	中色股份	16,147	88,647.03	0.20
233	000717	韶钢松山	20,000	88,600.00	0.20
234	600111	北方稀土	6,893	88,506.12	0.20
235	000937	冀中能源	22,821	88,089.06	0.20
236	002007	华兰生物	2,888	88,055.12	0.20
237	600273	嘉化能源	7,600	87,856.00	0.20
238	002075	沙钢股份	11,200	87,808.00	0.20
239	002129	中环股份	8,971	87,556.96	0.20
240	000550	江铃汽车	4,499	87,235.61	0.20
241	600565	迪马股份	23,250	86,722.50	0.20
242	600094	大名城	13,773	86,632.17	0.20
243	600787	中储股份	15,061	86,299.53	0.19
244	600388	龙净环保	6,944	86,036.16	0.19
245	600761	安徽合力	8,839	84,854.40	0.19
246	601717	郑煤机	14,850	84,793.50	0.19
247	600483	福能股份	9,900	84,744.00	0.19
248	600123	兰花科创	11,474	83,989.68	0.19
249	002739	万达电影	4,550	83,902.00	0.19
250	600737	中粮糖业	9,662	83,866.16	0.19
251	600569	安阳钢铁	28,697	83,795.24	0.19
252	603589	口子窖	1,300	83,746.00	0.19
253	600017	日照港	26,558	83,657.70	0.19
254	000789	万年青	8,345	83,616.90	0.19
255	002217	合力泰	14,965	82,756.45	0.19
256	601598	中国外运	17,190	82,340.10	0.19
257	600691	阳煤化工	31,100	81,793.00	0.18
258	600073	上海梅林	8,885	81,742.00	0.18
259	002152	广电运通	11,885	81,412.25	0.18
260	000598	兴蓉环境	17,805	81,012.75	0.18
261	600491	龙元建设	11,735	80,971.50	0.18
262	000877	天山股份	6,932	80,549.84	0.18
263	002191	劲嘉股份	6,468	80,267.88	0.18
264	000666	经纬纺机	6,445	80,240.25	0.18
265	600939	重庆建工	16,408	80,235.12	0.18
266	600711	盛屯矿业	14,800	80,068.00	0.18
267	600977	中国电影	5,075	79,474.50	0.18

268	000980	众泰汽车	18,800	79,148.00	0.18
269	601231	环旭电子	6,535	78,746.75	0.18
270	601021	春秋航空	1,739	78,255.00	0.18
271	600641	万业企业	6,600	78,012.00	0.18
272	002251	步步高	9,743	77,651.71	0.18
273	002051	中工国际	6,769	77,640.43	0.18
274	601966	玲珑轮胎	4,566	77,622.00	0.18
275	002309	中利集团	11,256	77,441.28	0.17
276	000564	供销大集	29,600	77,256.00	0.17
277	002157	正邦科技	4,599	76,619.34	0.17
278	600633	浙数文化	8,127	75,987.45	0.17
279	600973	宝胜股份	19,700	75,845.00	0.17
280	600315	上海家化	2,424	75,507.60	0.17
281	601928	凤凰传媒	9,307	75,107.49	0.17
282	600020	中原高速	14,281	74,975.25	0.17
283	600038	中直股份	1,822	74,738.44	0.17
284	002299	圣农发展	2,951	74,719.32	0.17
285	600566	济川药业	2,472	74,431.92	0.17
286	600185	格力地产	15,000	73,050.00	0.16
287	000400	许继电气	8,019	72,652.14	0.16
288	601777	力帆股份	16,913	72,556.77	0.16
289	603799	华友钴业	3,400	72,454.00	0.16
290	002242	九阳股份	3,475	72,314.75	0.16
291	002042	华孚时尚	9,900	71,874.00	0.16
292	600803	新奥股份	6,857	71,655.65	0.16
293	000089	深圳机场	8,000	71,120.00	0.16
294	600997	开滦股份	11,564	70,771.68	0.16
295	600686	金龙汽车	9,410	70,763.20	0.16
296	000021	深科技	8,628	70,145.64	0.16
297	002408	齐翔腾达	9,044	70,091.00	0.16
298	000902	新洋丰	6,472	69,444.56	0.16
299	600909	华安证券	10,566	69,101.64	0.16
300	300433	蓝思科技	9,882	68,877.54	0.16
301	600657	信达地产	16,624	68,490.88	0.15
302	002013	中航机电	9,806	67,465.28	0.15
303	600884	杉杉股份	6,239	66,445.35	0.15
304	603885	吉祥航空	5,064	66,338.40	0.15
305	002010	传化智联	8,800	66,264.00	0.15
306	600598	北大荒	6,173	66,236.29	0.15

307	002375	亚厦股份	11,131	65,784.21	0.15
308	600748	上实发展	7,900	65,491.00	0.15
309	600120	浙江东方	5,084	64,770.16	0.15
310	600162	香江控股	26,400	64,416.00	0.15
311	600908	无锡银行	11,398	64,284.72	0.15
312	600062	华润双鹤	5,011	63,188.71	0.14
313	600395	盘江股份	10,544	62,315.04	0.14
314	601878	浙商证券	6,700	62,310.00	0.14
315	600754	锦江股份	2,516	61,994.24	0.14
316	601886	江河集团	8,697	61,835.67	0.14
317	600093	易见股份	5,400	61,830.00	0.14
318	600648	外高桥	2,946	61,807.08	0.14
319	600006	东风汽车	11,482	61,199.06	0.14
320	002372	伟星新材	3,468	60,343.20	0.14
321	600580	卧龙电驱	7,142	60,064.22	0.14
322	601880	大连港	27,780	59,171.40	0.13
323	000031	大悦城	9,094	58,383.48	0.13
324	600809	山西汾酒	842	58,140.10	0.13
325	000620	新华联	13,600	56,304.00	0.13
326	603369	今世缘	2,000	55,780.00	0.13
327	300015	爱尔眼科	1,800	55,746.00	0.13
328	002267	陕天然气	6,784	55,560.96	0.13
329	601326	秦港股份	15,100	54,813.00	0.12
330	002503	搜于特	19,900	54,725.00	0.12
331	002302	西部建设	4,900	54,586.00	0.12
332	002203	海亮股份	4,982	53,905.24	0.12
333	601228	广州港	12,600	52,668.00	0.12
334	002602	世纪华通	4,700	51,324.00	0.12
335	601369	陕鼓动力	7,671	50,858.73	0.11
336	601801	皖新传媒	8,296	49,858.96	0.11
337	000537	广宇发展	7,200	49,824.00	0.11
338	601127	小康股份	3,760	49,256.00	0.11
339	000723	美锦能源	4,700	49,115.00	0.11
340	002624	完美世界	1,900	49,039.00	0.11
341	002032	苏泊尔	646	48,986.18	0.11
342	000938	紫光股份	1,747	47,605.75	0.11
343	000429	粤高速 A	6,210	46,885.50	0.11
344	002080	中材科技	5,159	46,740.54	0.11
345	603198	迎驾贡酒	2,608	46,709.28	0.11

346	002061	浙江交科	7,800	46,644.00	0.11
347	600420	现代制药	5,200	46,384.00	0.10
348	600295	鄂尔多斯	5,482	45,445.78	0.10
349	600667	太极实业	6,000	45,300.00	0.10
350	002482	广田集团	9,296	45,178.56	0.10
351	601566	九牧王	3,646	44,918.72	0.10
352	601019	山东出版	5,700	44,346.00	0.10
353	603328	依顿电子	4,300	44,161.00	0.10
354	601107	四川成渝	10,800	43,740.00	0.10
355	601163	三角轮胎	3,482	43,664.28	0.10
356	600231	凌钢股份	13,520	43,534.40	0.10
357	002745	木林森	3,700	43,364.00	0.10
358	000582	北部湾港	4,705	42,345.00	0.10
359	601958	金钼股份	6,263	41,962.10	0.09
360	000596	古井贡酒	354	41,952.54	0.09
361	000869	张裕 A	1,300	41,756.00	0.09
362	601212	白银有色	9,500	41,705.00	0.09
363	603056	德邦股份	2,900	40,832.00	0.09
364	600390	五矿资本	4,168	39,304.24	0.09
365	601577	长沙银行	4,000	38,160.00	0.09
366	002310	东方园林	6,300	37,800.00	0.09
367	601139	深圳燃气	6,607	37,593.83	0.08
368	000553	安道麦 A	3,500	37,520.00	0.08
369	002936	郑州银行	7,200	36,576.00	0.08
370	002314	南山控股	11,900	35,700.00	0.08
371	300251	光线传媒	5,200	35,360.00	0.08
372	002938	鹏鼎控股	1,200	35,232.00	0.08
373	300750	宁德时代	500	34,440.00	0.08
374	000761	本钢板材	7,896	33,952.80	0.08
375	000301	东方盛虹	6,100	33,489.00	0.08
376	603833	欧派家居	300	32,286.00	0.07
377	600299	安迪苏	2,900	30,073.00	0.07
378	603225	新凤鸣	2,320	28,976.80	0.07
379	002468	申通快递	1,100	27,434.00	0.06
380	002948	青岛银行	4,200	27,006.00	0.06
381	600233	圆通速递	2,066	25,473.78	0.06
382	000990	诚志股份	1,542	25,304.22	0.06
383	601298	青岛港	2,800	23,492.00	0.05
384	300741	华宝股份	700	22,190.00	0.05

385	002120	韵达股份	700	21,574.00	0.05
386	601068	中铝国际	2,900	20,010.00	0.05
387	603260	合盛硅业	400	18,824.00	0.04
388	002939	长城证券	1,100	18,359.00	0.04
389	603259	药明康德	200	17,336.00	0.04
390	600985	淮北矿业	1,500	17,010.00	0.04
391	000987	越秀金控	1,848	16,668.96	0.04
392	300760	迈瑞医疗	100	16,320.00	0.04
393	601860	紫金银行	2,000	15,080.00	0.03
394	601360	三六零	600	12,828.00	0.03
395	001872	招商港口	500	8,155.00	0.02
396	601258	庞大集团	1,400	1,806.00	0.00

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	占基金资产净值比例（%）
1	600485	*ST 信威	4,762	29,905.36	0.07

积极投资股票为被动持有非当前成分股，将逐步进行调整成分股。

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	600100	同方股份	253,528.00	0.67
2	000039	中集集团	249,290.00	0.65
3	600418	江淮汽车	239,925.00	0.63
4	600276	恒瑞医药	214,060.10	0.56
5	601333	广深铁路	199,838.00	0.52
6	600166	福田汽车	196,419.00	0.52
7	600664	哈药股份	187,454.00	0.49
8	600528	中铁工业	173,544.00	0.46
9	000413	东旭光电	172,608.00	0.45
10	000878	云南铜业	169,938.00	0.45
11	601233	桐昆股份	169,651.00	0.45
12	000066	中国长城	168,702.00	0.44

13	000983	西山煤电	167,835.00	0.44
14	601901	方正证券	167,772.00	0.44
15	600522	中天科技	161,955.00	0.42
16	600717	天津港	153,520.00	0.40
17	600307	酒钢宏兴	150,800.00	0.40
18	603858	步长制药	146,308.00	0.38
19	601168	西部矿业	140,563.00	0.37
20	600369	西南证券	140,400.00	0.37

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。

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	002157	正邦科技	324,567.64	0.85
2	601555	东吴证券	272,260.95	0.71
3	601997	贵阳银行	241,412.22	0.63
4	000550	江铃汽车	231,691.33	0.61
5	000401	冀东水泥	230,991.84	0.61
6	601168	西部矿业	218,883.91	0.57
7	601099	太平洋	216,759.60	0.57
8	002092	中泰化学	196,685.35	0.52
9	300226	上海钢联	192,358.90	0.50
10	000961	中南建设	190,435.86	0.50
11	600276	恒瑞医药	178,358.82	0.47
12	600522	中天科技	171,461.85	0.45
13	000728	国元证券	162,752.04	0.43
14	000671	阳光城	162,285.73	0.43
15	000703	恒逸石化	160,274.00	0.42
16	600782	新钢股份	152,768.00	0.40
17	601012	隆基股份	148,836.78	0.39
18	600039	四川路桥	145,519.66	0.38
19	000600	建投能源	141,453.93	0.37
20	600067	冠城大通	139,441.56	0.37

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。

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	16,242,396.24
卖出股票收入（成交）总额	17,821,801.01

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

报告期末本基金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

报告期末本基金未投资贵金属。

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

报告期末本基金未持有权证。

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

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.10.2 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。

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

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

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	244.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	729.15
5	应收申购款	499.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,472.61

7.12.4 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。

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

报告期末本基金投资前十名中不存在流通受限情况。

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

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	*ST 信威	29,905.36	0.07	重大事项

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰信基本面 400A	59	18,025.07	0.00	0.00%	1,063,479.00	100.00%
泰信基本面 400B	371	2,866.52	108.00	0.01%	1,063,371.00	99.99%
泰信基本面 400	503	87,119.65	34,262,456.81	78.19%	9,558,726.21	21.81%
合计	933	49,247.74	34,262,564.81	74.57%	11,685,576.21	25.43%

8.2 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	蔡小婉	207,066.00	19.47%
2	李惠莲	168,400.00	15.83%
3	余志胜	110,546.00	10.39%
4	高明桂	90,000.00	8.46%
5	吴益群	83,604.00	7.86%
6	孙林红	70,237.00	6.60%
7	刘辉荣	53,900.00	5.07%
8	赖明理	44,000.00	4.14%
9	吕谷城	42,400.00	3.99%
10	谢晋龙	36,100.00	3.39%

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	307,125.00	28.88%
2	杨一木	59,956.00	5.64%
3	李建灵	43,300.00	4.07%
4	吉庆伍	38,094.00	3.58%
5	张仁仓	36,000.00	3.39%
6	张建斌	23,349.00	2.20%
7	崔文涛	22,428.00	2.11%

8	王方	19,539.00	1.84%
9	孙丽君	16,713.00	1.57%
10	包素芹	15,700.00	1.48%

8.3 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份额。

8.4 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

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。

§ 9 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	905,303.00	905,303.00	44,080,767.84
本报告期期间基金总申购份额	-	-	1,225,308.64
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-	1,912,387.95
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	158,176.00	158,176.00	427,494.49
本报告期末基金份额总额	1,063,479.00	1,063,479.00	43,821,183.02

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

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

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

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	
川财证券	1	18,855,217.21	55.96%	17,559.67	56.49%	-
广发证券	2	14,839,905.31	44.04%	13,523.73	43.51%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

东北证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	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	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	1	-	-	-	-	-

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:无;退租交易单元:无。

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
川财证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰信 400A 停复牌公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 1 月 3 日
2	泰信 400A 份额第八个运作周年约定收益率的公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 1 月 3 日
3	泰信 400 基金定期折算结果及泰信 400A 份额恢复交易的公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 1 月 4 日
4	泰信 400A 定期折算后复牌首日前收盘价调整的公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 1 月 4 日
5	调整东海证券定投业务最低申购金额	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 1 月 18 日

6	18 年 4 季度报告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 1 月 21 日
7	暂停旗下基金在大泰金石相关销售业务	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 1 月 30 日
8	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 1 日
9	停牌股票估值调整 (信威集团)	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 20 日
10	新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定投及费率优惠业务的公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 20 日
11	提示投资者更新身份信息公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 22 日
12	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 26 日
13	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 27 日
14	调整投资者开户证件类型类型的公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 27 日
15	18 年年度报告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 28 日
16	提示投资者更新身份信息公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 29 日
17	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 29 日
18	工行费率优惠	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 3 月 30 日
19	提示投资者更新身份信息公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 4 月 4 日
20	提示投资者更新身份信息公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 4 月 16 日

		网站 (www.ftfund.com)	
21	B 类份额溢价风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 4 月 16 日
22	19 年 1 季度报告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 4 月 18 日
23	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 4 月 20 日
24	B 类份额溢价风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 4 月 23 日
25	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 5 月 6 日
26	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 5 月 9 日
27	提示投资者更新身份信息公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 5 月 14 日
28	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 5 月 14 日
29	参加北京恒天明泽基金销售有限公司申购费率优惠业务	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 5 月 17 日
30	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 5 月 18 日
31	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 5 月 28 日
32	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 6 月 1 日
33	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 6 月 9 日
34	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019 年 6 月 12 日

35	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 6 月 15 日
36	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 6 月 19 日
37	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 6 月 22 日
38	可投资科创板股票公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 6 月 22 日
39	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 6 月 26 日
40	参加中国银行定投费率优惠	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 6 月 27 日
41	B 类份额交易价格波动风险提示公告	《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2019 年 6 月 29 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	20190101 - 20190630	18,634,755.83	302,034.20	0.00	18,936,790.03	41.21%
	2	20190101 - 20190630	15,373,590.89	249,176.89	300,000.00	15,322,767.78	33.35%
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>							

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的办公场所，供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后，投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

12.3 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)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 8 月 24 日