

泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资 基金（LOF）2020 年第 4 季度报告

（原泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金）

2020 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

报告送出日期：2021 年 1 月 21 日

§ 1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同已于 2021 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会于 2020 年 10 月 21 日获得表决通过关于《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，根据议案以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，本基金管理人已将《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金托管协议》修订为《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）托管协议》。本基金以 2020 年 11 月 20 日为基金份额转换基准日，以泰信基本面 400 份额的基金份额净值为基准，泰信 400A 份额、泰信 400B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成泰信基本面 400 份额的场内份额。泰信 400A 份额、泰信 400B 份额于 2020 年 11 月 20 日终止上市。自 2020 年 11 月 24 日起，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF），《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）托管协议》于 2020 年 11 月 24 日生效。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

| | |
|--------|---------------|
| 基金简称 | 泰信基本面 400 |
| 场内简称 | 泰信 400 |
| 交易代码 | 162907 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） |

| | |
|------------|---|
| 基金合同生效日 | 2020 年 11 月 24 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 38,891,838.26 份 |
| 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。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,以分享中国经济的长期增长成果,实现基金资产的长期增值。 |
| 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,其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |
| 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 |

注:泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金于 2020 年 11 月 24 日变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(LOF)。

转型前:

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 泰信基本面 400 指数分级 |
| 场内简称 | 泰信 400 |
| 交易代码 | 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 39,447,860.47 份 |
| 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。 |
| 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 |

| | | | |
|-----------------|------------|------------|-----------------|
| 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的份额总额 | 0.00 份 | 0.00 份 | 39,447,860.47 份 |

注：本基金以 2020 年 11 月 20 日为基金份额转换基准日，以泰信基本面 400 份额的基金份额净值为基准，泰信 400A 份额、泰信 400B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成泰信基本面 400 份额的场内份额。泰信 400A 份额、泰信 400B 份额于 2020 年 11 月 20 日终止上市。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2020 年 11 月 24 日 — 2020 年 12 月 31 日） |
|-----------------|--|
| 1. 本期已实现收益 | -96,051.15 |
| 2. 本期利润 | -1,170,790.99 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0299 |
| 4. 期末基金资产净值 | 44,959,131.11 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1560 |

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2020 年 10 月 1 日 — 2020 年 11 月 23 日） |
|-----------------|---|
| 1. 本期已实现收益 | -39,555.09 |
| 2. 本期利润 | 3,404,367.49 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0861 |
| 4. 期末基金资产净值 | 46,772,653.15 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1860 |

3.2 基金净值表现（转型后）

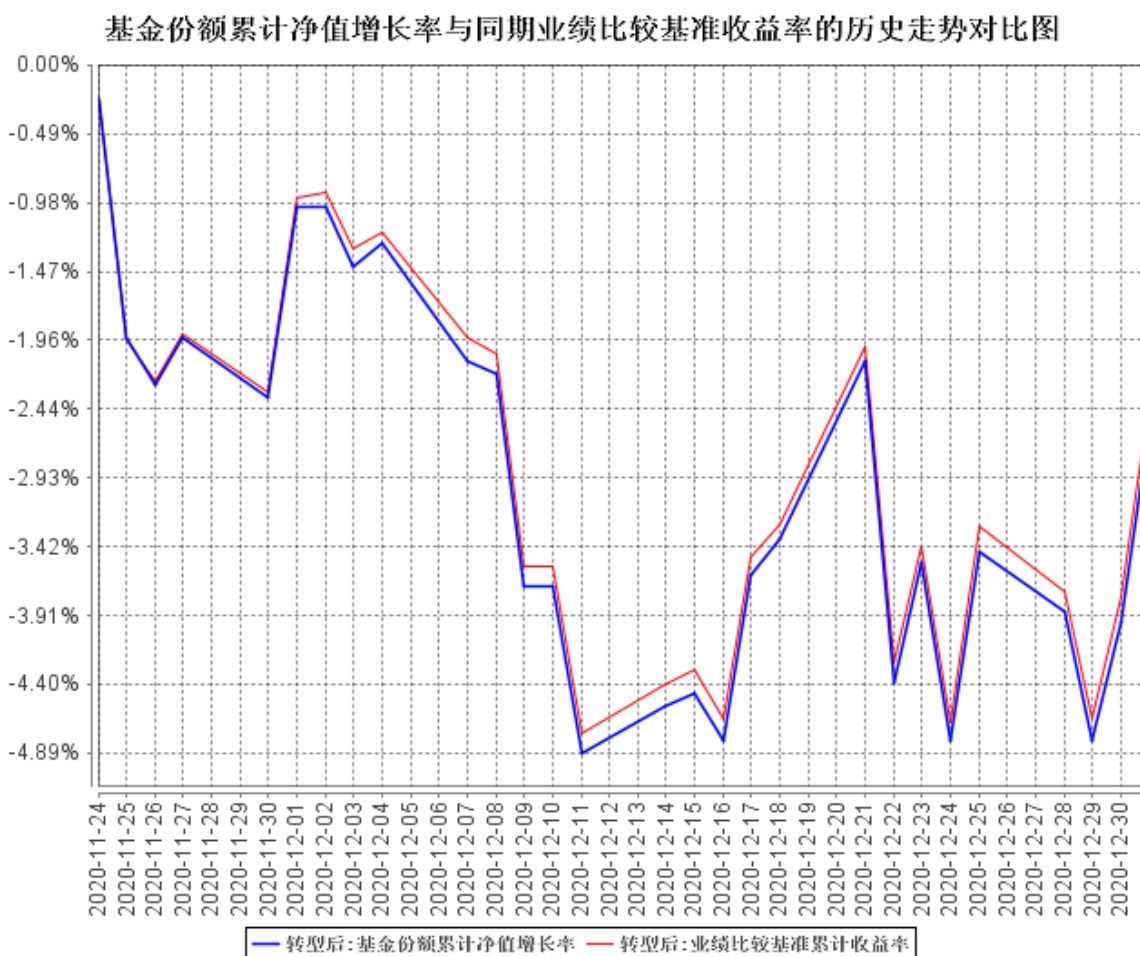
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | -2.53% | 1.01% | -2.36% | 1.01% | -0.17% | 0.00% |

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）

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金于 2020 年 11 月 24 日变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）。“过去三个月”实际时间段为 2020 年 11 月 24 日至 2020 年 12 月 31 日。

3.2.2 自基金合同转型以来基金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



注：1、泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金于 2020 年 11 月 24 日变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）。

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。

3.2 基金净值表现（转型前）

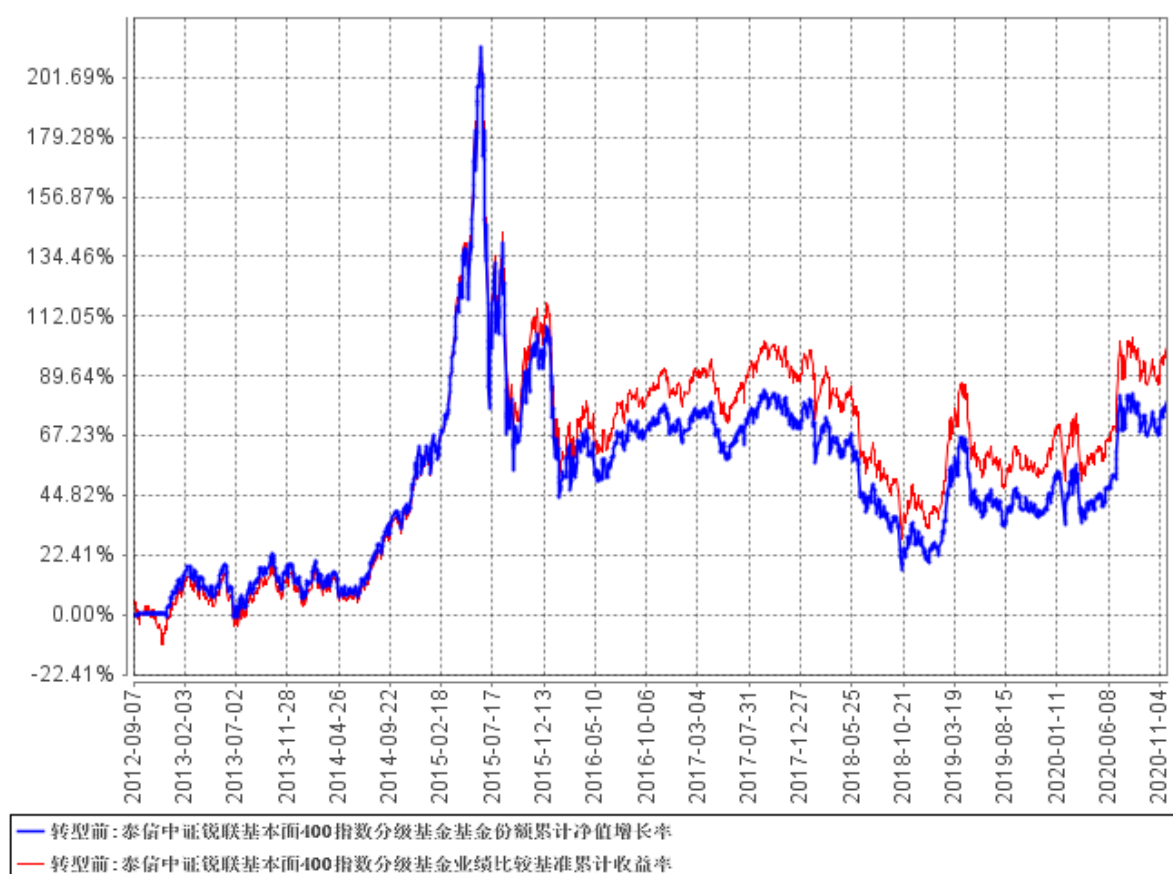
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | 0.51% | 1.07% | 0.14% | 1.09% | 0.37% | -0.02% |
| 过去六个月 | 28.08% | 1.36% | 27.02% | 1.36% | 1.06% | 0.00% |
| 过去一年 | 31.23% | 1.45% | 31.25% | 1.46% | -0.02% | -0.01% |
| 过去三年 | 4.54% | 1.40% | 5.39% | 1.42% | -0.85% | -0.02% |
| 过去五年 | -10.64% | 1.40% | -5.18% | 1.41% | -5.46% | -0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 80.37% | 1.59% | 100.51% | 1.61% | -20.14% | -0.02% |

注：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（税后）

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

泰信中证锐联基本面400指数分级基金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%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|------|---|----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张彦先生 | 本基金基金经理、泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理、泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2015 年 1 月 6 日 | - | 14 年 | 张彦先生，同济大学产业经济学专业硕士。历任百联集团投资经理助理、国金证券研究所研究员、上海从容投资管理有限公司研究员、万家基金管理有限公司研究员。2011 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理。2015 年 1 月至今任泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金经理（原泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转型），2015 年 1 月至今任泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至今任泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

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。

3、于 2020 年 11 月 24 日起，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF），基金经理未发生变化。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|------|---|----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张彦先生 | 本基金基金经理、泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理、泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2015 年 1 月 6 日 | - | 14 年 | 张彦先生，同济大学产业经济学专业硕士。历任百联集团投资经理助理、国金证券研究所研究员、上海从容投资管理有限公司研究员、万家基金管理有限公司研究员。2011 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理。2015 年 1 月至今任泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金经理（原泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转型），2015 年 1 月至今任泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至今任泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

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。

3、于 2020 年 11 月 24 日起，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF），基金经理未发生变化。

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》、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《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相关的各环节，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，基金经理严格遵守公平、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本基金与其他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 报告期内基金投资策略和运作分析

4 季度市场整体上涨，上证指数上涨 7.92%，深证成指上涨 12.11%，中小板上涨 10.07%，创业板上涨 15.21%。

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 0.77%。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后：截至 2020 年 12 月 31 日本基金份额净值为 1.1560 元，过去三个月（实际时间段为 2020 年 11 月 24 日至 2020 年 12 月 31 日）基金份额净值增长率为-2.53%，业绩比较基准收益率为-2.36%；

转型前：截至 2020 年 11 月 23 日本基金份额净值为 1.1860 元，过去三个月基金份额净值增

长率为 0.51%，业绩比较基准收益率为 0.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金于 2020 年 10 月 9 日至 2020 年 12 月 31 日有连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。自 2020 年 11 月 24 日起，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金正式变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF），泰信 400A 份额、泰信 400B 份额取消分级并终止上市。本基金在 2020 年 4 季度内进行了基金转型。

§ 5 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 42,509,856.10 | 94.17 |
| | 其中：股票 | 42,509,856.10 | 94.17 |
| 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 | 2,630,466.35 | 5.83 |
| 8 | 其他资产 | 2,389.89 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 45,142,712.34 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 332,999.70 | 0.74 |
| B | 采矿业 | 2,391,401.71 | 5.32 |
| C | 制造业 | 24,963,695.89 | 55.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 877,581.32 | 1.95 |
| E | 建筑业 | 1,043,186.13 | 2.32 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| F | 批发和零售业 | 2,935,846.14 | 6.53 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,532,864.82 | 3.41 |
| H | 住宿和餐饮业 | 123,465.88 | 0.27 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 821,361.11 | 1.83 |
| J | 金融业 | 3,828,355.21 | 8.52 |
| K | 房地产业 | 2,067,212.62 | 4.60 |
| L | 租赁和商务服务业 | 547,241.52 | 1.22 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 129,061.76 | 0.29 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 219,277.25 | 0.49 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 16,300.32 | 0.04 |
| Q | 卫生和社会工作 | 122,969.38 | 0.27 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 515,145.50 | 1.15 |
| S | 综合 | 41,889.84 | 0.09 |
| | 合计 | 42,509,856.10 | 94.55 |

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 601012 | 隆基股份 | 6,765 | 623,733.00 | 1.39 |
| 2 | 600438 | 通威股份 | 12,340 | 474,349.60 | 1.06 |
| 3 | 000039 | 中集集团 | 29,772 | 446,282.28 | 0.99 |
| 4 | 600176 | 中国巨石 | 16,487 | 329,080.52 | 0.73 |
| 5 | 600409 | 三友化工 | 30,588 | 313,527.00 | 0.70 |
| 6 | 601168 | 西部矿业 | 25,257 | 312,681.66 | 0.70 |
| 7 | 600893 | 航发动力 | 5,233 | 310,578.55 | 0.69 |
| 8 | 601233 | 桐昆股份 | 14,822 | 305,184.98 | 0.68 |
| 9 | 002241 | 歌尔股份 | 7,893 | 294,566.76 | 0.66 |
| 10 | 000830 | 鲁西化工 | 22,831 | 291,780.18 | 0.65 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本基金本报告期投资的前十名证券中发行主体未发生被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 2,137.78 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 252.11 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,389.89 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未持有流通受限股票。

5.11.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 44,255,426.21 | 94.35 |
| | 其中：股票 | 44,255,426.21 | 94.35 |
| 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 | 2,631,640.26 | 5.61 |
| 8 | 其他资产 | 18,428.99 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 46,905,495.46 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 310,497.44 | 0.66 |
| B | 采矿业 | 2,457,440.23 | 5.25 |
| C | 制造业 | 25,483,225.02 | 54.48 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,072,938.83 | 2.29 |
| E | 建筑业 | 1,171,189.00 | 2.50 |
| F | 批发和零售业 | 3,262,976.39 | 6.98 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,620,272.87 | 3.46 |
| H | 住宿和餐饮业 | 117,404.00 | 0.25 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 903,063.78 | 1.93 |
| J | 金融业 | 3,810,362.09 | 8.15 |
| K | 房地产业 | 2,364,738.38 | 5.06 |
| L | 租赁和商务服务业 | 598,171.83 | 1.28 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 102,985.00 | 0.22 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 243,960.11 | 0.52 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 17,956.80 | 0.04 |
| Q | 卫生和社会工作 | 106,023.94 | 0.23 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 564,334.50 | 1.21 |
| S | 综合 | 47,886.00 | 0.10 |
| | 合计 | 44,255,426.21 | 94.62 |

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 000039 | 中集集团 | 29,772 | 464,145.48 | 0.99 |
| 2 | 601012 | 隆基股份 | 6,765 | 457,990.50 | 0.98 |
| 3 | 600438 | 通威股份 | 12,340 | 404,628.60 | 0.87 |
| 4 | 601168 | 西部矿业 | 25,257 | 343,495.20 | 0.73 |
| 5 | 600166 | 福田汽车 | 88,392 | 319,095.12 | 0.68 |
| 6 | 601233 | 桐昆股份 | 14,822 | 316,301.48 | 0.68 |
| 7 | 600409 | 三友化工 | 30,588 | 304,962.36 | 0.65 |
| 8 | 002241 | 歌尔股份 | 7,893 | 302,222.97 | 0.65 |
| 9 | 000830 | 鲁西化工 | 22,831 | 300,912.58 | 0.64 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 10 | 600176 | 中国巨石 | 16,487 | 294,292.95 | 0.63 |
|----|--------|------|--------|------------|------|

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本基金本报告期投资的前十名证券中发行主体未发生被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 2,112.05 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,680.23 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 14,636.71 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 18,428.99 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未持有流通受限股票。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

| | |
|------------------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2020年11月24日）基金份额总额 | 39,447,860.47 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 194,435.67 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 750,456.88 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少） | -1.00 |

| | |
|-------------|---------------|
| 以“-”填列) | |
| 报告期期末基金份额总额 | 38,891,838.26 |

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| 项目 | 泰信基本面 400A | 泰信基本面 400B | 泰信基本面 400 |
|-------------------------------|-------------|-------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 596,049.00 | 596,049.00 | 38,402,573.63 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - | 21,891.53 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - | 168,702.69 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列） | -596,049.00 | -596,049.00 | 1,192,098.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 0.00 | 0.00 | 39,447,860.47 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

单位：份

| | |
|--------------------------|---------------|
| 基金合同生效日管理人持有的本基金份额 | 15,710,482.63 |
| 基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额 | 0.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 15,710,482.63 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 40.40 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

单位：份

| | |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 15,710,482.63 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 15,710,482.63 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 39.83 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 20201001-20201231 | 19,415,951.10 | - | - | 19,415,951.10 | 49.92% |
| | 2 | 20201001-20201231 | 15,710,482.63 | - | - | 15,710,482.63 | 40.40% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]241 号（《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》）准予变更注册。泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会于 2020 年 10 月 21 日获得表决通过关于《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，根据议案以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，本基金管理人将《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金托管协议》修订为《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）托管协议》，并据此拟定了《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

依据深圳证券交易所的业务规则和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金以 2020 年 11 月 20 日为基金份额转换基准日，以泰信基本面 400 份额的基金份额净值为基准，泰信 400A 份额、泰信 400B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成泰信基本面 400 份额的场内份额。依据深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2020]1049 号），泰信 400A 份额、泰信 400B 份额于 2020 年 11 月 20 日终止上市。

自 2020 年 11 月 24 日起，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF），《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）托管协议》于 2020 年 11 月 24 日生效。

§ 9 备查文件目录

10.1 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，变更的文件
- 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 指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- 4、《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》
- 5、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 6、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金托管协议》

- 7、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- 8、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9、基金托管人业务资格批件和营业执照

10.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，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。

10.3 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
2021 年 1 月 21 日