

泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金
（LOF）（原泰信中证锐联基本面 400 指
数分级证券投资基金转型）
2020 年年度报告

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

送出日期：2021 年 3 月 29 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 2021 年 3 月 26 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。

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。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料（转型后）.....	8
2.5 其他相关资料（转型前）.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	9
3.2 基金净值表现（转型前）.....	12
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
4.9 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.....	20
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	21
§6 审计报告（转型后）	22
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
§6 审计报告（转型前）	25
6.1 审计报告基本信息.....	25
6.2 审计报告的基本内容.....	25
§7 年度财务报表（转型后）	28
7.1 资产负债表（转型后）.....	28
7.2 利润表.....	29
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	30
7.4 报表附注.....	31
§7 年度财务报表（转型前）	52

7.1 资产负债表（转型前）	52
7.2 利润表	53
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	54
7.4 报表附注	55
§8 投资组合报告（转型后）	81
8.1 期末基金资产组合情况	81
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	81
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	82
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	92
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	93
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	93
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	93
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	93
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	93
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	93
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	93
8.12 投资组合报告附注	93
§8 投资组合报告（转型前）	95
8.1 期末基金资产组合情况	95
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	95
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	96
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	106
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	108
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	108
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	108
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	108
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	108
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	108
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	108
8.12 投资组合报告附注	108
§9 基金份额持有人信息（转型后）	110
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	110
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	110
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	110
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	110
§9 基金份额持有人信息（转型前）	111
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	111
9.2 期末上市基金前十名持有人	111
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	111
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	111
§10 开放式基金份额变动(转型后)	112
§10 开放式基金份额变动(转型前)	113
§11 重大事件揭示	114
11.1 基金份额持有人大会决议	114

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	114
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	115
11.4 基金投资策略的改变	115
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	116
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	116
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	116
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	118
11.9 其他重大事件（转型后）	121
11.9 其他重大事件（转型前）	121
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	126
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	126
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	126
§13 备查文件目录.....	127
13.1 备查文件目录.....	127
13.2 存放地点.....	127
13.3 查阅方式.....	127

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	泰信基本面 400
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	2020 年 11 月 24 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	38,891,838.26 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	暂未上市

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)。

2.1 基金基本情况（转型前）

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	泰信中证锐联基本面 400 指数分级基金		
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	39,447,860.47 份		
基金合同存续期（若有）	不定期		
基金份额上市的证券交易所（若有）	深圳证券交易所		
上市日期（若有）	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	0.00 份	0.00 份	39,447,860.47 份

注：泰信 400A 份额、泰信 400B 份额于 2020 年 11 月 20 日终止上市。

2.2 基金产品说明（转型后）

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的成果，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。

2.2 基金产品说明（转型前）

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（若有）	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（若有）	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
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（转型后）

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 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

2.5 其他相关资料（转型前）

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-96,051.15
本期利润	-1,170,790.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0299
本期加权平均净值利润率	-2.60%
本期基金份额净值增长率	-2.53%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	14,228,593.86
期末可供分配基金份额利润	0.3659
期末基金资产净值	44,959,131.11
期末基金份额净值	1.1560
3.1.3 累计期末指标	2020 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	-2.53%

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 日	2019 年	2018 年
本期已实现收益	697,778.17	-2,960,723.24	-458,482.68
本期利润	9,254,253.03	8,474,208.29	-16,247,330.19
加权平均基金份额本期利润	0.2108	0.1840	-0.2706
本期加权平均净值利润率	20.33%	19.19%	-34.07%
本期基金份额净值增长率	31.23%	22.00%	-29.70%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年 11 月 23 日	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	14,528,416.17	14,804,008.43	6,710,835.24
期末可供分配基金份额利润	0.3705	0.3242	0.1462
期末基金资产净值	46,772,653.15	45,556,692.20	38,119,756.43
期末基金份额净值	1.186	0.998	0.831
3.1.3 累计期末指标	2020 年 11 月 23 日	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	80.37%	47.98%	21.29%

3.2 基金净值表现（转型后）

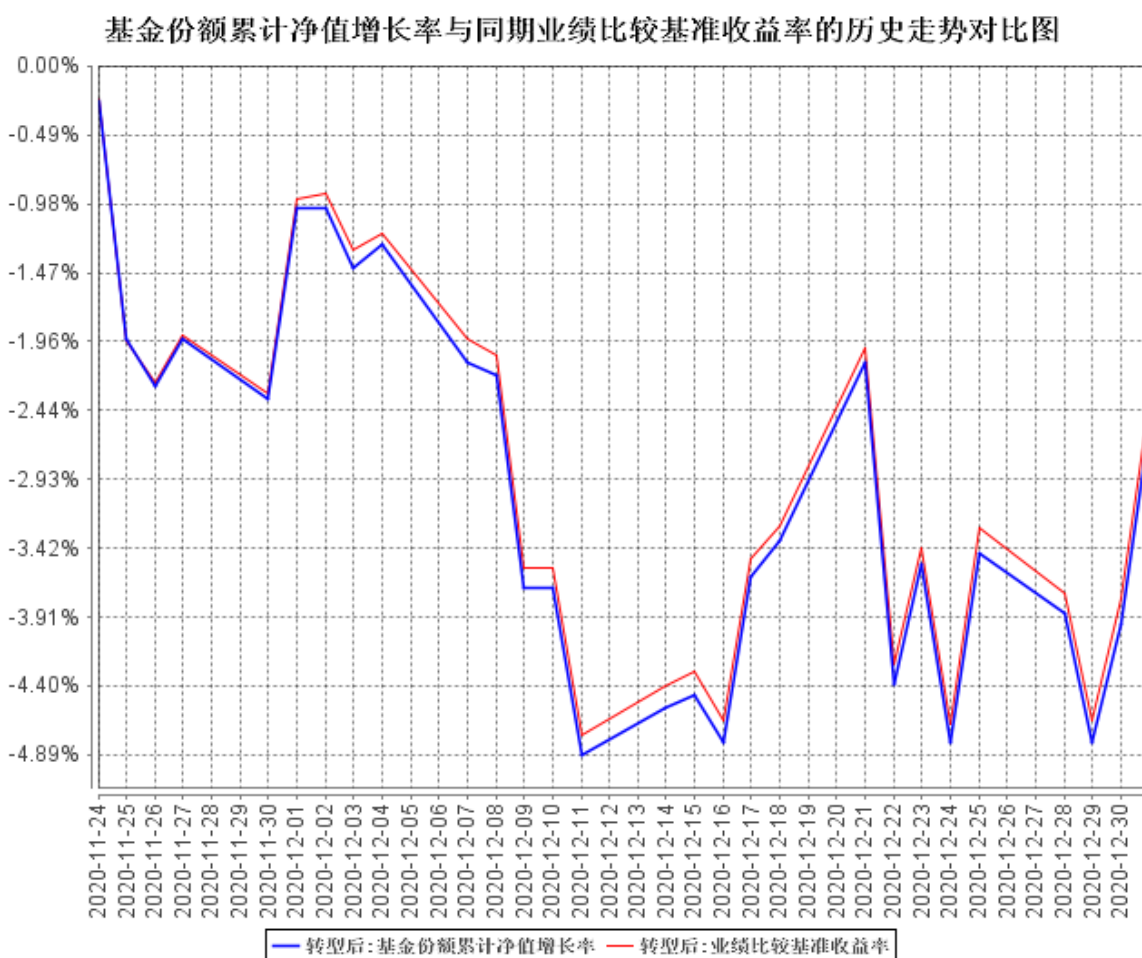
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	-2.53%	1.01%	-2.36%	1.01%	-0.17%	0.00%

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）

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 自基金转型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



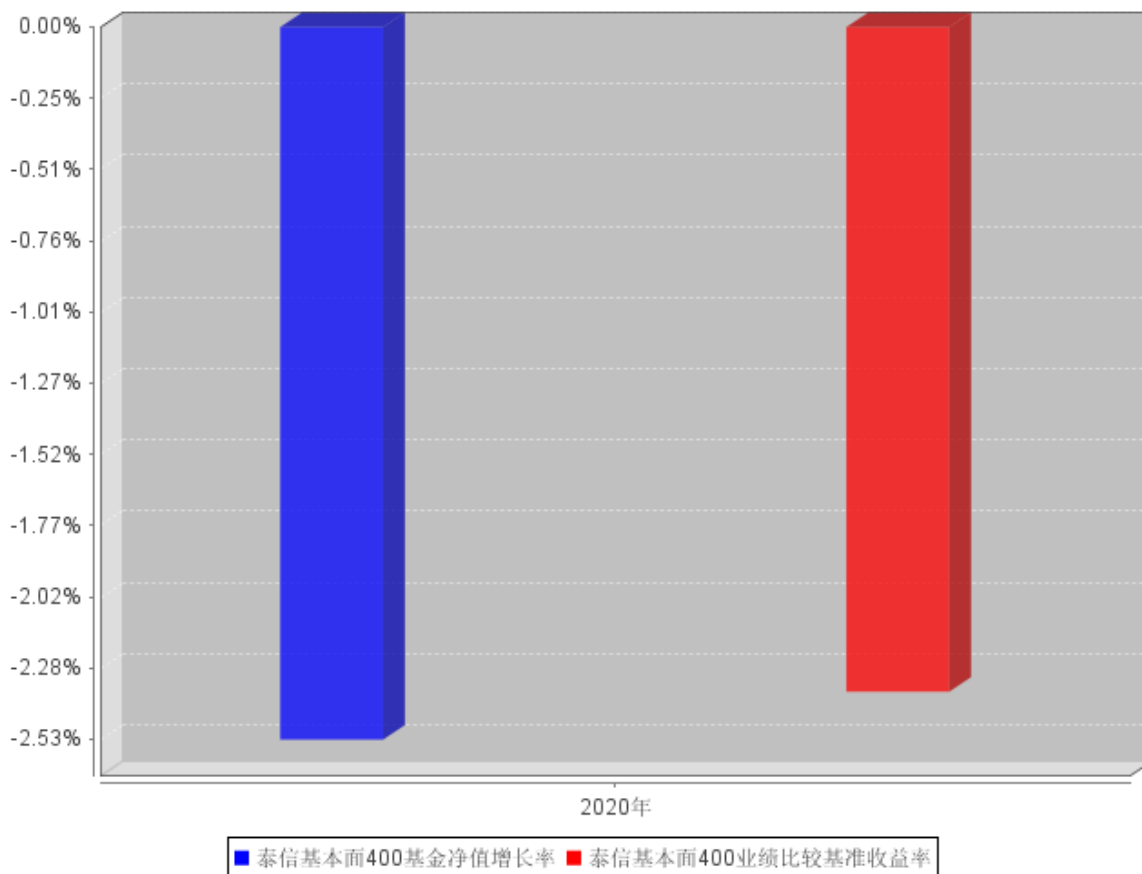
注：1、泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金于 2020 年 11 月 24 日变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）。

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。

3.2.3 自基金转型以来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

泰信基本面400自基金转型以来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



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）。” 2020 年度“实际时间段为 2020 年 11 月 24 日至 2020 年 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现（转型前）

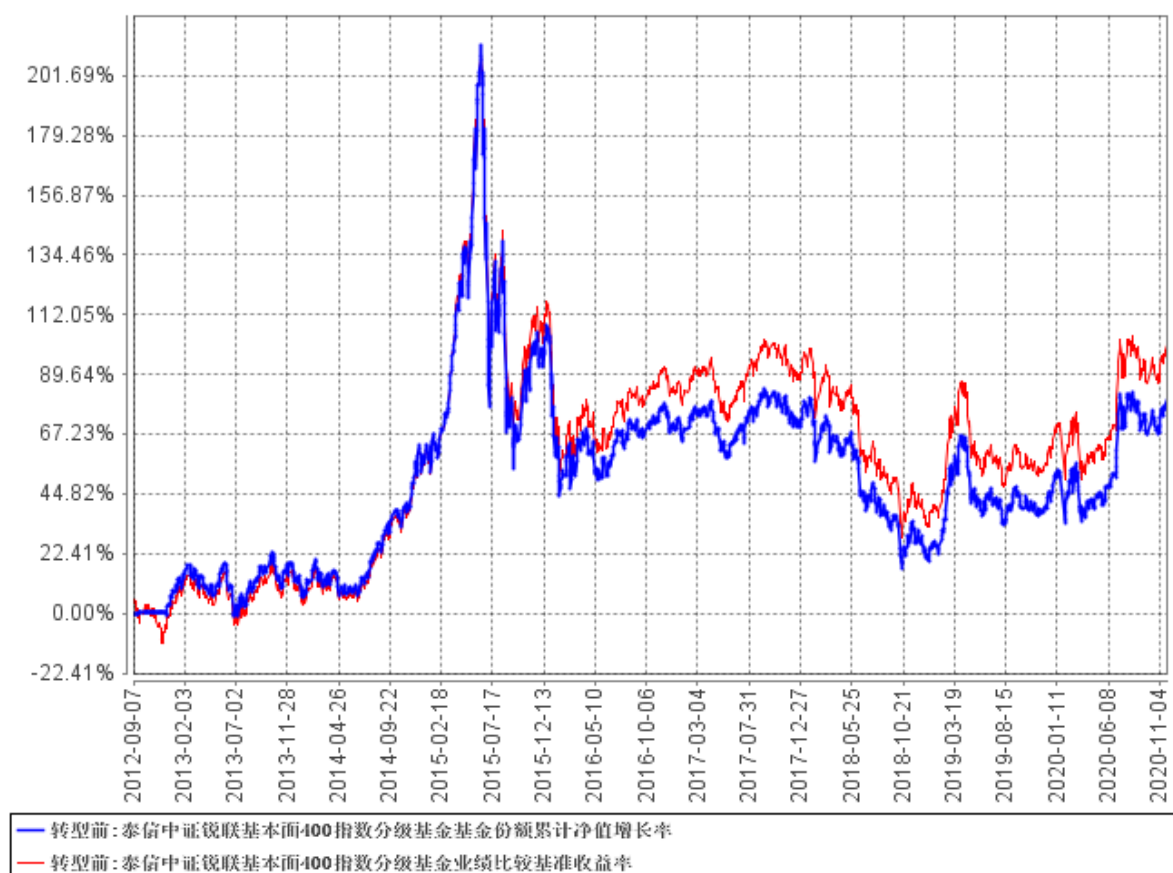
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

泰信中证锐联基本面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

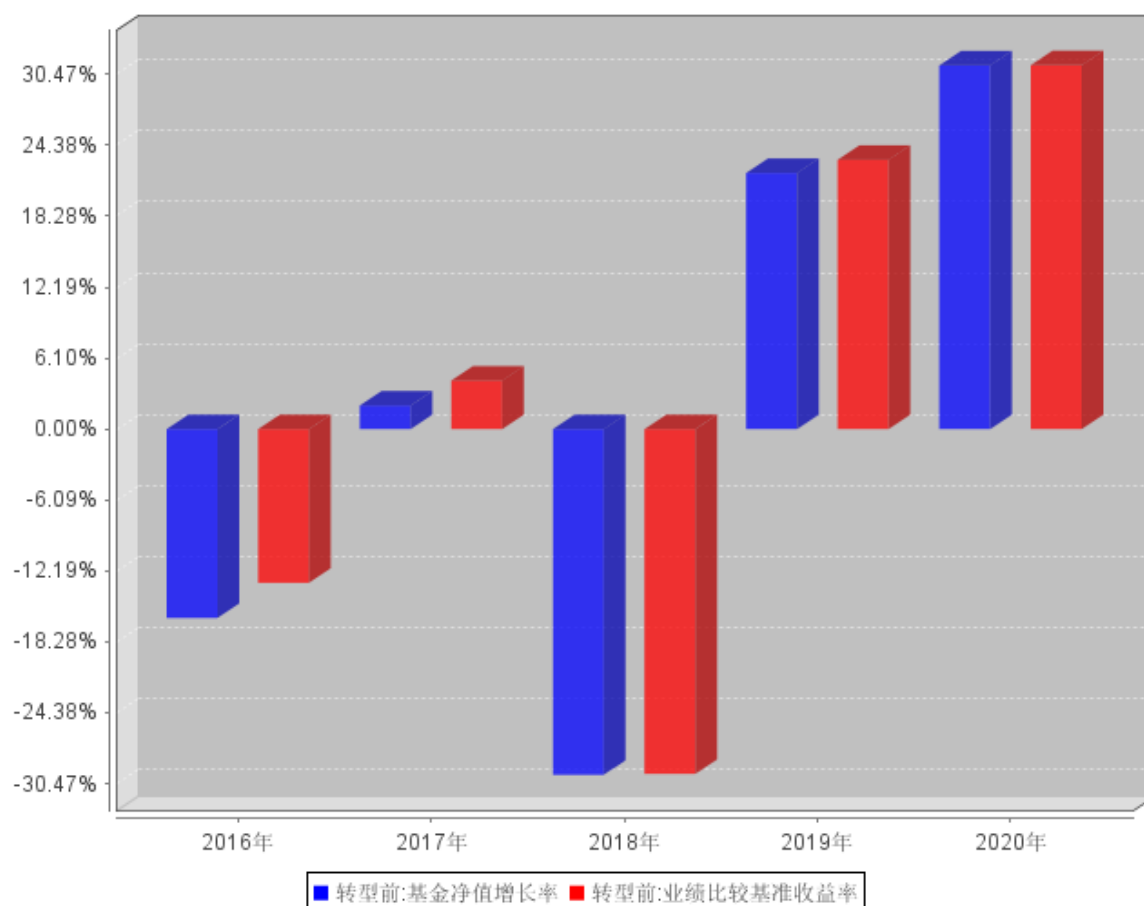


注：1、本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。

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%。

3.2.3 自合同生效以来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

转型前

依据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金》基金合同，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。

转型后

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）。本报告期末进行利润分配。

§ 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：高宇

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“好人举手”制度下，获准筹建的第一家以信托公司为主发起人的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、营销支持中心、产品研发部、渠道服务部、战略客户部、机构业务部、深圳分公司、北京分公司、金融科技部、权益投资部、固收投资部、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 2020 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 2020 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、泰信基本面 400、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 10 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（转型后）

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	泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）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	2020 年 11 月 24 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、任职日期是指公司公告日期；

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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	泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金经理、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	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 指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 1 月至今任泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理

	混合型证券投资基金基金经理				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、任职日期是指公司公告日期；

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型后）

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型前）

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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 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《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 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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

2020 年虽受疫情影响，但在政策和流动性充裕双重利好提振下，市场大幅上涨，上证指数、深证成指、中小板指、创业板指和沪深 300 分别上涨 14%、39%、44%、65%和 27%。行业方面，电气设备、休闲服务和食品饮料表现强势，上涨均超 80%，国防军工、医药生物、汽车、电子等板块涨幅靠前，房地产、通信、建筑装饰和纺织服装等行业有所下跌。市场分化严重：2020 年，接近 50% 左右的股价是下跌的，30% 左右的股票跑赢沪深 300 指数，15% 左右的股票跑赢创业板指。

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 0.9%。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

转型后：截至 2020 年 12 月 31 日本基金份额净值为 1.1560 元，过去一年（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，过去一年基金份额净值增长率为 31.23%，业绩比较基准收益率为 31.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年，新冠疫情席卷全球，但为避免世界经济陷入长期衰退，在主要国家和央行积极干预下，经济在下半年开始走复苏。我国率先控制住疫情，经济先行修复，证券市场也开始企稳，并逐步走高。

展望 2021 年，尽管短期受到疫情的再次干扰，但是经济复苏的趋势不会改变。一是内需逐步恢复正常，经济活动基本恢复正常。二是中国制造比较优势疫情期间突显，在海外生产受阻的情况下，中国商品保障了海外疫情期间的消费，出口增长强劲。

全球释放的流动性在疫情没有消除之前难以全面紧缩。国内货币政策要保持对经济恢复的必要支持力度，不断强化流动性维稳预期。虽不段短期调控节奏，央行并没有彻底拐头。整体上半年维持相对宽松局面，后续变化我们认为有赖于经济复苏的程度和通胀预期。

对证券市场而言，我们预期比 2020 年相对保守，一是当前 A 股估值水平已经并不便宜，风险溢价处于高位；二是市场投资高度集中，实际盈利增长远远低于估值水平，存在局部泡沫。2021 年市场投资收益更多依赖于业绩的驱动。

我们认为全年的投资机会经济继续复苏，尤其是制造业变现突出，同时上游原材料、医疗服务、食品饮料、新能源车等景气度继续保持。其次是疫情受损行业今年也有望走出低迷，行业有望重估。

作为指数型基金产品，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，本基金管理人合规管理及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，包括投资指标阈值设置、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。本年度进一步加强对投研人员的通讯管理，更新了手机保管设备，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

高宇先生，博士。2020 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司总经理。

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，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，现任权益投资部副总监，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

转型前：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。

转型后：本基金收益分配应遵循下列原则：

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额的持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额的持有人只能选择现金分红的方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的规定；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

转型后，截至本报告期末本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金于 2020 年 1 月 2 日至 2020 年 7 月 8 日、2020 年 8 月 6 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 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 指数证券投资基金（LOF）（原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 指数证券投资基金（LOF）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 指数证券投资基金（LOF）（原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 指数证券投资基金（LOF）（原泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金）2020 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（转型后）

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	德师报(审)字(21)第 P01368 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 指数证券投资基金 (LOF) 全体持有人:
审计意见	<p>我们审计了泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF) 的财务报表, 包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表, 2020 年 11 月 24 日至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</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中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制, 公允反映了泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年 12 月 31 日的财务状况、2020 年 11 月 24 日至 2020 年 12 月 31 日止期间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。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF), 并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>泰信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作, 如果我们确定其他信息存在重大错报, 我们应当报告该事实。在这方面, 我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委

责任	<p>员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,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中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF) 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中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF)、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中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF) 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,保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 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>(2) 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>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 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,就可能导致对泰信中证锐联基本面</p>

	<p>400 指数证券投资基金 (LOF) 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中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容, 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	德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	汪润松 罗佳
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 26 日

§ 6 审计报告（转型前）

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	德师报(审)字(21)第 P01378 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持有人：
审计意见	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的财务报表，包括 2020 年 11 月 23 日(基金合同失效前日)的资产负债表，2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 日(基金合同失效前日)止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。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中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 2020 年 11 月 23 日(基金合同失效前日)的财务状况、2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	泰信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 2020 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金、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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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,保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 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>(2) 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>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 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。</p>

	<p>同时，根据获取的审计证据，就可能对泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	汪润松 罗佳
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	2,630,466.35
结算备付金		-
存出保证金		2,137.78
交易性金融资产	7.4.7.2	42,509,856.10
其中：股票投资		42,509,856.10
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		-
应收利息	7.4.7.5	252.11
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		45,142,712.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	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		44,864.35
应付管理人报酬		37,926.37
应付托管费		8,343.80
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	1,171.35
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	91,275.36
负债合计		183,581.23
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	25,548,318.82
未分配利润	7.4.7.10	19,410,812.29
所有者权益合计		44,959,131.11
负债和所有者权益总计		45,142,712.34

注：1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1560 元，基金份额总额 38,891,838.26 份。

2、本基金合同于 2020 年 11 月 24 日生效，本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 11 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 11 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2020 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-1,098,261.60
1. 利息收入		955.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	955.16
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-25,545.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-28,737.26
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	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	3,192.10
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,074,739.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,068.24

减：二、费用		72,529.39
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	46,754.29
2. 托管费	7.4.10.2.2	10,285.96
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,289.67
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	7.4.7.20	14,199.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,170,790.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,170,790.99

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 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 11 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 11 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 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）	25,913,573.69	20,859,079.46	46,772,653.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,170,790.99	-1,170,790.99
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）	-365,254.87	-277,476.18	-642,731.05
其中：1. 基金申购款	127,724.60	99,670.16	227,394.76
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-492,979.47	-377,146.34	-870,125.81
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）	25,548,318.82	19,410,812.29	44,959,131.11

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：

高宇

叶振宇

叶振宇

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 指数证券投资基金(LOF)(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。本基金为契约开放式,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 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。原基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。自 2020 年 11 月 24 日起,本基金由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)。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。

根据《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金实施转型的公告》,2020 年 9 月 15 日至 2020 年 10 月 20 日期间管理人召开了以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会,审议通过了《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》。自 2020 年 11 月 24 日起,《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》将生效,原《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》将自同一日起失效。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)。

根据《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金份额转换结果的公告》,泰信基本面 400 份额的场内份额和场外份额将分别自动转换成泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(LOF)基金份额的场内份额和场外份额。以 2020 年 11 月 20 日为份额转换基准日,泰信 400A 份额 582,949.00 份转换为泰信 400 份额的场内份额 519,124.00 份,泰信 400B 份额 582,949.00 份转换为泰信 400 份额的场内份额 646,773.00 份。2020 年 11 月 24 日更名后,泰信 400 份额的场内份额 1,336,550.00 份转换为泰信基本面 400 指数份额(场内份额) 1,336,550.00 份,泰信 400 份额的场外份额 38,111,309.47 份转换为泰信基本面 400 指数份额(场外份额) 38,111,309.47 份。

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允许基金投资的其他股票)、债券(含国债、央行票据、金融债券、企业

债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券等、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券、权证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(但需符合中国证监会的相关规定)。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)。

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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制, 同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求, 真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度, 即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求, 本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。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，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债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。贷款及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。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，贷款及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。当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时公司股票公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净

值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

3) 公允价值变动收益 公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额的持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额的持有人只能选择现金分红的方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的规定；

2. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3. 每一基金份额享有同等分配权；如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

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和债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) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，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，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈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〉的通知》(中基协发[2014]24 号), 在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外), 采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股票的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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 2020 年 12 月 31 日
活期存款	2,630,466.35
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：	2,630,466.35

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	39,258,050.20	42,509,856.10	3,251,805.90
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	39,258,050.20	42,509,856.10	3,251,805.90

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	251.11
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	-
应收出借证券利息	-
其他	1.00
合计	252.11

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,171.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,171.35

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9.30
应付证券出借违约金	-
预提费用	80,000.00
应付指数使用费	11,266.06
合计	91,275.36

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 11 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	39,447,860.47	25,913,573.69
基金份额折算调整	-1.00	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	194,435.67	127,724.60
本期赎回 (以“-”号填列)	-750,456.88	-492,979.47
本期末	38,891,838.26	25,548,318.82

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至 2020 年 12 月 31 日止，本基金无于深交所上市的基金份额，托管在场内未上市交易的基金份额为 790,850.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 38,100,988.26 份。场内的泰信基本份额登记在证券登记结算系统，场外的泰信基本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。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	14,528,416.17	6,330,663.29	20,859,079.46
本期利润	-96,051.15	-1,074,739.84	-1,170,790.99
本期基金份额交易产生的变动数	-203,771.16	-73,705.02	-277,476.18
其中：基金申购款	71,254.57	28,415.59	99,670.16
基金赎回款	-275,025.73	-102,120.61	-377,146.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,228,593.86	5,182,218.43	19,410,812.29

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2020 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	944.83
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	-0.13
其他	10.46
合计	955.16

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 2020 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	642,093.01
减：卖出股票成本总额	670,830.27
买卖股票差价收入	-28,737.26

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及无债券投资收益。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,192.10
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	3,192.10
----	----------

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年11月24日(基金合同生效日)至2020 年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,074,739.84
——股票投资	-1,074,739.84
——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	-
合计	-1,074,739.84

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年11月24日(基金合同生效日)至2020 年12月31日
基金赎回费收入	1,068.24
合计	1,068.24

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年11月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,289.67	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,289.67	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年11月24日(基金合同生效日)至2020 年12月31日
审计费用	-10,327.60
信息披露费	5,191.92
证券出借违约金	-
律师费	8,636.44
指数使用费	4,675.44
持有人大会费用	6,000.27
银行划款手续费	23.00
合计	14,199.47

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

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、直售机构
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
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
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联方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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无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
	2020年11月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	46,754.29
其中：支付销售机构的客户维护费	1,879.50

注：2020年12月31日前本基金的管理费按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提本基金的管理费，管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年11月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日

当期发生的基金应支付的托管费	10,285.96
----------------	-----------

注：2020 年 12 月 31 日前本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提本基金的托管费，托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期末未产生销售服务费。

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

本基金本报告期内未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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2020 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日持有的基金份额	15,710,482.63
报告期初持有的基金份额	15,710,482.63
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	15,710,482.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	40.40%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 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
山东国托	19,415,951.10	49.92%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,630,466.35	944.83

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配的情况。

7.4.12 期末（2020 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

本基金本报告期末无因认购新发/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

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

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债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资（主要是指指数成份

股、备选成份股)、债券投资等。与这些金融工具有关的风险,以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平,保证本基金的基金资产安全,维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标,本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险,确定适当的风险容忍度,并及时可靠地对各种风险进行监督,将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括:市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的,监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国工商银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式,以控制相应的信用风险。

对于与债券投资相关的信用风险,本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象,并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。于 2020 年 12 月 31 日,本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现,进而无法对投资者赎回款或基金其它应付款按时支付的风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式

基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

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，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该比例限制）。

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。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 2020 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

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 2020 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 45,140,322.45 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，包括利率风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,630,466.35	-	-	-	2,630,466.35
存出保证金	2,137.78	-	-	-	2,137.78
交易性金融资产	-	-	-	42,509,856.10	42,509,856.10
应收利息	-	-	-	252.11	252.11
资产总计	2,632,604.13	-	-	42,510,108.21	45,142,712.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	44,864.35	44,864.35
应付管理人报酬	-	-	-	37,926.37	37,926.37
应付托管费	-	-	-	8,343.80	8,343.80
应付交易费用	-	-	-	1,171.35	1,171.35
其他负债	-	-	-	91,275.36	91,275.36
负债总计	-	-	-	183,581.23	183,581.23
利率敏感度缺口	2,632,604.13	-	-	42,326,526.98	44,959,131.11

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末均无债券投资，因此，市场利率的变动对基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	42,509,856.10	94.55
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	42,509,856.10	94.55

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5%，其他变量不变	
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（2020 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,255,437.53
2. 业绩比较基准下降 5%	-2,255,437.53	

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析

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) 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银行存款、买入返售金融资产和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 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 2020 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 42,509,856.10 元,无属于第二层次的余额,无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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,本基金分别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或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(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。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

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：2020 年 11 月 23 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 11 月 23 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,631,640.26	3,652,699.72
结算备付金		-	-
存出保证金		2,112.05	576.43
交易性金融资产	7.4.7.2	44,255,426.21	42,062,985.71
其中：股票投资		44,255,426.21	42,062,985.71
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,680.23	735.28
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	14,636.71	-
资产总计		46,905,495.46	45,716,997.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 11 月 23 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
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		5,880.88	8,989.07
应付管理人报酬		28,399.09	37,204.72
应付托管费		6,247.79	8,185.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	580.71	-
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	91,733.84	105,926.11
负债合计		132,842.31	160,304.94
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	25,913,573.69	30,752,683.77
未分配利润	7.4.7.10	20,859,079.46	14,804,008.43
所有者权益合计		46,772,653.15	45,556,692.20
负债和所有者权益总计		46,905,495.46	45,716,997.14

注：报告截止日 2020 年 11 月 23 日，基金份额总额 39,447,860.47 份，其中泰信基本面 400A 基金份额净值 1.000 元，份额总额 0.00 份；泰信基本面 400B 基金份额净值 1.000 元，份额总额 0.00 份；泰信基本面 400 基金份额净值 1.000 元，份额总额 0.00 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		10,019,268.35	9,281,011.39
1. 利息收入		14,040.62	26,133.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	14,040.62	26,133.97
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,442,072.10	-2,184,528.58
其中：股票投资收益	7.4.7.12	711,325.31	-2,950,304.99
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	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	730,746.79	765,776.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	8,556,474.86	11,434,931.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	6,680.77	4,474.47

列)			
减：二、费用		765,015.32	806,803.10
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	406,811.78	440,618.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	89,498.55	96,936.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	54,129.99	51,801.97
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	7.4.7.20	214,575.00	217,445.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,254,253.03	8,474,208.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,254,253.03	8,474,208.29

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 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）	30,752,683.77	14,804,008.43	45,556,692.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,254,253.03	9,254,253.03
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）	-4,839,110.08	-3,199,182.00	-8,038,292.08
其中：1. 基金申购款	1,636,286.86	1,175,816.92	2,812,103.78
2. 基金赎回款	-6,475,396.94	-4,374,998.92	-10,850,395.86
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）	25,913,573.69	20,859,079.46	46,772,653.15
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	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）	-	8,474,208.29	8,474,208.29
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）	-656,237.42	-381,035.10	-1,037,272.52
其中：1. 基金申购款	1,032,423.26	487,141.77	1,519,565.03
2. 基金赎回款	-1,688,660.68	-868,176.87	-2,556,837.55
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）	30,752,683.77	14,804,008.43	45,556,692.20

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：

_____	_____	_____
高宇	叶振宇	叶振宇
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《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金实施转型的公告》，2020 年 9 月 15 日至 2020 年 10 月 20 日期间管理人召开了以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，审议通过了《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》。自 2020 年 11 月 24 日起，《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》将生效，原《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》将自同一起失效。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)。

根据《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金份额转换结果的公告》，泰信基本面 400 份额的场内份额和场外份额将分别自动转换成泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额的场内份额和场外份额。以 2020 年 11 月 20 日为份额转换基准日，泰信 400A 份额 582,949.00 份转换为泰信 400 份额的场内份额 519,124.00 份，泰信 400B 份额 582,949.00 份转换为泰信 400 份额的场内份额 646,773.00 份。2020 年 11 月 24 日更名后，泰信 400 份额的场内份额 1,336,550.00 份转换为泰信基本面 400 指数份额(场内份额)1,336,550.00 份，泰信 400 份额的场外份额 38,111,309.47 份转换为泰信基本面 400 指数份额(场外份额)38,111,309.47 份。

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 $95\% \times \text{中证锐联基本面 400 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率 (税后)}$ 。

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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 11 月 23 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 日(基金合同失效前日)止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。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,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债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。贷款及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。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，贷款及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。当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的可相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无

市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

3) 公允价值变动收益 公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额的持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再

投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额的持有人只能选择现金分红的方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的规定；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

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和债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) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，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，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈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〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)

的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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 2020 年 11 月 23 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	2,631,640.26	3,652,699.72
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,631,640.26	3,652,699.72

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 11 月 23 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	39,928,880.47	44,255,426.21	4,326,545.74
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	39,928,880.47	44,255,426.21	4,326,545.74

项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	46,292,914.83	42,062,985.71	-4,229,929.12
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	46,292,914.83	42,062,985.71	-4,229,929.12

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无衍生金融工具。

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无买入返售金融资产。

7.4.7.4.1 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度可比期间本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 11 月 23 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,654.79	734.98
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	19.98	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	5.46	0.30
合计	1,680.23	735.28

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月23日	上年度末 2019年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	14,636.71	-
合计	14,636.71	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月23日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	580.71	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	580.71	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月23日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7.54	24.59
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	85,135.68	95,000.00
应付指数使用费	6,590.62	10,901.52
合计	91,733.84	105,926.11

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰信基本面 400		
项目	本期 2020年1月1日至2020年11月23日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,660,625.30	30,752,683.77
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-4,177.05	-2,814.05
基金拆分/份额折算前	45,656,448.25	30,749,869.72
基金拆分/份额折算变动份额	1,155,252.57	-

本期申购	2,490,876.54	1,636,286.86
本期赎回(以“-”号填列)	-9,854,717.89	-6,472,582.89
本期末	39,447,859.47	25,913,573.69

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至 2020 年 11 月 23 日止，本基金无于深交所上市的基金份额(2019 年 12 月 31 日：2,044,610.00 份)，本基金托管在场内未上市交易的基金份额为 240,637.00 份(2019 年 12 月 31 日：2,044,610.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 38,111,310.47 份(2019 年 12 月 31 日：托管在场外未上市交易的基金份额为 43,375,378.30 份)。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。

3. 根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金合同》的相关规定和《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司确定 2020 年 1 月 2 日为份额折算基准日，对泰信基本面 400 份额的场内、场外份额和泰信基本面 400A 份额实施定期份额折算。折算前，泰信基本面 400 场外和场内份额分别为 43,371,201.25 份和 240,637.00 份，根据基金份额折算公式，新增份额折算比例为 0.025303186，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 44,468,630.82 份和 298,460.00 份，泰信基本面 400 份额净值为 0.988 元；折算前，泰信基本面 400A 份额总额为 1,022,305.00 份，根据基金份额折算公式，新增份额折算比例为 0.050606372，折算后泰信基本面 400A 份额总额为 1,022,305.00 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。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 份额和泰信基本面 400A 份额进行了折算，并于 2020 年 1 月 6 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	16,471,223.35	-1,667,214.92	14,804,008.43
本期利润	697,778.17	8,556,474.86	9,254,253.03
本期基金份额交易产生的变动数	-2,640,585.35	-558,596.65	-3,199,182.00
其中：基金申购款	905,168.38	270,648.54	1,175,816.92
基金赎回款	-3,545,753.73	-829,245.19	-4,374,998.92
本期已分配利润	-	-	-

本期末	14,528,416.17	6,330,663.29	20,859,079.46
-----	---------------	--------------	---------------

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月23日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	13,864.24	25,888.46
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	167.33	238.03
其他	9.05	7.48
合计	14,040.62	26,133.97

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 2020年1月1日至2020年11月23日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	20,292,618.49	17,651,294.94
减：卖出股票成本总额	19,581,293.18	20,601,599.93
买卖股票差价收入	711,325.31	-2,950,304.99

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 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 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。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11 月23日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
股票投资产生的股利收益	730,746.79	765,776.41
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	730,746.79	765,776.41

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年11 月23日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	8,556,474.86	11,434,931.53
——股票投资	8,556,474.86	11,434,931.53
——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	8,556,474.86	11,434,931.53

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11 月23日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
基金赎回费收入	6,680.77	4,474.47
合计	6,680.77	4,474.47

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月23日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	54,129.99	51,801.97
银行间市场交易费用	-	-
合计	54,129.99	51,801.97

注：本基金本报告期末及上年度末无持有基金产生的费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月23日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	40,327.60	45,000.00
信息披露费	44,808.08	50,000.00
证券出借违约金	-	-
债券账户维护费——中债登	18,000.00	18,000.00
律师费	6,363.56	-
指数使用费	40,681.03	44,061.96
持有人大会费用	8,999.73	-
上市年费	55,000.00	60,000.00
银行划款手续费	395.00	384.00
债券账户维护费——上清所	-	-
合计	214,575.00	217,445.96

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

除附注 7.4.1 所述，本基金于 2020 年 11 月 23 日自泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转换为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF），本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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
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
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联方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无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无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无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无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

本基金本报告期及上年度可比期间均无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
	2020年1月1日至2020年11月23日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	406,811.78	440,618.99
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	2,150.74	50,650.52

注：2020年11月23日（基金合同失效前日）前本基金的管理费按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提本基金的管理费，管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

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
	2020年1月1日至2020年11月23日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	89,498.55	96,936.18

注：2020年11月23日（基金合同失效前日）前本基金的托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提本基金的托管费，托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 日		
	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
基金合同生效日持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	15,322,767.78
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	387,714.85
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	15,710,482.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	39.83%

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
----	---

	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
基金合同生效日持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	15,373,590.89
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	249,176.89
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	300,000.00
报告期末持有的基金份额	-	-	15,322,767.78
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	33.56%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰信基本面 400				
关联方名称	本期末 2020 年 11 月 23 日		上年度末 2019 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	19,415,951.10	49.22%	18,936,790.03	41.47%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 23 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	2,631,640.26	13,864.24	3,652,699.72	25,888.46

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配的情况。

7.4.12 期末（2020 年 11 月 23 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**

本基金本报告期末无因认购新发/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
601966	玲珑轮胎	2020年11月20日	重大事项	32.65	2020年11月26日	32.80	3,692	66,503.83	120,543.80	-
002075	沙钢股份	2020年11月19日	重大事项	16.70	2020年11月25日	16.00	6,626	53,999.14	110,654.20	-

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债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末及上年度末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

于 2020 年 11 月 23 日(基金合同失效前日)，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2019 年 12 月 31 日:同。)

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法对投资者赎回款或基金其它应付款按时支付的风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

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该比例限制）。

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。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 2020 年 12 月 31 日(基金合同失效前日)，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 0.4943%。

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 2020 年 11 月 23 日(基金合同失效前日)，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 46,655,868.47 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，包括利率风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资。利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2020年11月23日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,631,640.26	-	-	-	2,631,640.26
存出保证金	2,112.05	-	-	-	2,112.05
交易性金融资产	-	-	-	44,255,426.21	44,255,426.21
应收利息	-	-	-	1,680.23	1,680.23
其他资产	-	-	-	14,636.71	14,636.71
资产总计	2,633,752.31	-	-	44,271,743.15	46,905,495.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,880.88	5,880.88
应付管理人报酬	-	-	-	28,399.09	28,399.09
应付托管费	-	-	-	6,247.79	6,247.79
应付交易费用	-	-	-	580.71	580.71
其他负债	-	-	-	91,733.84	91,733.84
负债总计	-	-	-	132,842.31	132,842.31
利率敏感度缺口	2,633,752.31	-	-	44,138,900.84	46,772,653.15

上年度末 2019 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	3,652,699.72	-	-	-	3,652,699.72
存出保证金	576.43	-	-	-	576.43
交易性金融资产	-	-	-	42,062,985.71	42,062,985.71
应收利息	-	-	-	735.28	735.28
资产总计	3,653,276.15	-	-	42,063,720.99	45,716,997.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,989.07	8,989.07
应付管理人报酬	-	-	-	37,204.72	37,204.72
应付托管费	-	-	-	8,185.04	8,185.04
其他负债	-	-	-	105,926.11	105,926.11
负债总计	-	-	-	160,304.94	160,304.94
利率敏感度缺口	3,653,276.15	-	-	-41,903,416.05	45,556,692.20

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均无债券投资，因此，市场利率的变动对基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 11 月 23 日		上年度末 2019 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	44,255,426.21	94.62	42,062,985.71	92.33
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	44,255,426.21	94.62	42,062,985.71	92.33

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5%，其他变量不变		
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（2020 年 11 月 23 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,145,792.67	2,508,400.79
2. 业绩比较基准下降 5%	-2,145,792.67	-2,508,400.79	

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析

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) 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银行存款、买入返售金融资产和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 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 2020 年 11 月 23 日（基金合同失效前日），本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 44,024,228.21 元，第二层次的余额为人民币 231,198.00 元，无属于第三层次的余额（2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 41,896,706.75 元，第二层次的余额为人民币 166,278.96 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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，本基金分别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或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(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（转型后）

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	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	其他各项资产	2,389.89	0.01
9	合计	45,142,712.34	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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	24,877,304.26	55.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	963,972.95	2.14
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

8.2.2 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。

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

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	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
11	600426	华鲁恒升	7,760	289,448.00	0.64
12	600166	福田汽车	88,392	278,434.80	0.62
13	600739	辽宁成大	11,158	271,362.56	0.60
14	000488	晨鸣纸业	41,584	266,969.28	0.59
15	002475	立讯精密	4,589	257,534.68	0.57
16	000768	中航西飞	6,868	251,918.24	0.56
17	000983	山西焦煤	43,490	245,283.60	0.55
18	300059	东方财富	7,734	239,754.00	0.53
19	601636	旗滨集团	18,646	238,668.80	0.53
20	601555	东吴证券	23,947	236,117.42	0.53
21	000878	云南铜业	16,312	236,034.64	0.52
22	000786	北新建材	5,548	222,197.40	0.49
23	600325	华发股份	35,433	220,038.93	0.49
24	600522	中天科技	19,764	214,241.76	0.48

25	002078	太阳纸业	14,786	213,361.98	0.47
26	600109	国金证券	13,107	213,250.89	0.47
27	300124	汇川技术	2,279	212,630.70	0.47
28	002001	新和成	6,261	210,870.48	0.47
29	601901	方正证券	20,112	208,561.44	0.46
30	600348	阳泉煤业	36,870	206,840.70	0.46
31	000591	太阳能	28,200	205,014.00	0.46
32	600584	长电科技	4,723	201,058.11	0.45
33	000059	华锦股份	35,880	198,057.60	0.44
34	600711	盛屯矿业	21,320	195,291.20	0.43
35	000963	华东医药	7,235	192,161.60	0.43
36	600873	梅花生物	39,725	185,118.50	0.41
37	600516	方大炭素	26,036	184,074.52	0.41
38	600143	金发科技	10,707	183,517.98	0.41
39	600039	四川路桥	40,559	182,921.09	0.41
40	002183	怡亚通	41,874	182,570.64	0.41
41	000581	威孚高科	7,614	176,568.66	0.39
42	000066	中国长城	9,132	173,416.68	0.39
43	000540	中天金融	54,617	172,043.55	0.38
44	000728	国元证券	19,098	171,118.08	0.38
45	000960	锡业股份	15,212	170,374.40	0.38
46	601128	常熟银行	22,825	168,448.50	0.37
47	601108	财通证券	13,266	167,814.90	0.37
48	002236	大华股份	8,429	167,652.81	0.37
49	600884	杉杉股份	9,289	167,480.67	0.37
50	600699	均胜电子	6,533	165,676.88	0.37
51	600100	同方股份	26,716	165,639.20	0.37
52	000060	中金岭南	34,234	165,007.88	0.37
53	600208	新潮中宝	53,099	164,606.90	0.37
54	000423	东阿阿胶	4,194	162,349.74	0.36
55	601717	郑煤机	14,801	161,774.93	0.36
56	002221	东华能源	15,937	161,601.18	0.36
57	002271	东方雨虹	4,164	161,563.20	0.36
58	002385	大北农	16,684	161,167.44	0.36
59	002081	金螳螂	17,108	160,644.12	0.36
60	600418	江淮汽车	13,121	160,469.83	0.36
61	000623	吉林敖东	9,719	160,071.93	0.36
62	600079	人福医药	4,724	160,049.12	0.36
63	600266	城建发展	31,442	159,725.36	0.36

64	600881	亚泰集团	50,971	158,010.10	0.35
65	600369	西南证券	29,249	157,359.62	0.35
66	600497	驰宏锌锗	32,693	156,926.40	0.35
67	000933	神火股份	19,577	156,224.46	0.35
68	300207	欣旺达	5,024	154,287.04	0.34
69	300226	上海钢联	2,350	154,160.00	0.34
70	601699	潞安环能	23,465	152,522.50	0.34
71	600567	山鹰国际	49,430	149,278.60	0.33
72	600060	海信视像	12,990	149,125.20	0.33
73	600528	中铁工业	17,023	148,781.02	0.33
74	002008	大族激光	3,473	148,470.75	0.33
75	600061	国投资本	10,732	148,423.56	0.33
76	601058	赛轮轮胎	24,457	147,720.28	0.33
77	300433	蓝思科技	4,787	146,530.07	0.33
78	600970	中材国际	21,297	146,523.36	0.33
79	002340	格林美	20,902	146,104.98	0.32
80	000401	冀东水泥	10,284	145,518.60	0.32
81	603799	华友钴业	1,829	145,039.70	0.32
82	600859	王府井	4,441	144,687.78	0.32
83	002244	滨江集团	31,387	144,066.33	0.32
84	600535	天士力	9,702	143,492.58	0.32
85	300408	三环集团	3,843	143,151.75	0.32
86	600390	五矿资本	20,478	142,936.44	0.32
87	601866	中远海发	47,869	142,170.93	0.32
88	601666	平煤股份	23,962	142,094.66	0.32
89	603156	养元饮品	5,432	140,362.88	0.31
90	600710	苏美达	24,808	138,924.80	0.31
91	600487	亨通光电	9,794	137,018.06	0.30
92	600664	哈药股份	42,345	135,080.55	0.30
93	000690	宝新能源	18,500	135,050.00	0.30
94	600583	海油工程	30,051	134,928.99	0.30
95	000034	神州数码	6,272	134,597.12	0.30
96	002500	山西证券	15,026	134,482.70	0.30
97	002004	华邦健康	24,237	134,272.98	0.30
98	600511	国药股份	2,714	133,827.34	0.30
99	600600	青岛啤酒	1,335	132,699.00	0.30
100	600466	蓝光发展	28,620	132,510.60	0.29
101	600809	山西汾酒	352	132,102.08	0.29
102	601198	东兴证券	9,915	132,067.80	0.29

103	603858	步长制药	5,696	131,406.72	0.29
104	000807	云铝股份	17,270	130,043.10	0.29
105	002936	郑州银行	29,125	129,897.50	0.29
106	601966	玲珑轮胎	3,692	129,847.64	0.29
107	000550	江铃汽车	6,286	129,743.04	0.29
108	002958	青农商行	25,366	129,112.94	0.29
109	603259	药明康德	958	129,061.76	0.29
110	000050	深天马 A	8,725	128,606.50	0.29
111	601000	唐山港	51,642	128,072.16	0.28
112	600056	中国医药	8,931	127,981.23	0.28
113	002299	圣农发展	4,805	127,524.70	0.28
114	000012	南玻 A	17,264	127,408.32	0.28
115	002416	爱施德	17,000	126,820.00	0.28
116	600256	广汇能源	44,677	126,435.91	0.28
117	600096	云天化	20,810	126,316.70	0.28
118	002129	中环股份	4,941	125,995.50	0.28
119	000750	国海证券	21,492	125,943.12	0.28
120	300072	三聚环保	21,830	123,994.40	0.28
121	002233	塔牌集团	9,719	123,820.06	0.28
122	600717	天津港	25,834	123,486.52	0.27
123	600754	锦江酒店	2,396	123,465.88	0.27
124	300015	爱尔眼科	1,642	122,969.38	0.27
125	600307	酒钢宏兴	73,713	121,626.45	0.27
126	000686	东北证券	12,311	120,894.02	0.27
127	600549	厦门钨业	7,166	120,747.10	0.27
128	002456	欧菲光	9,152	120,623.36	0.27
129	600729	重庆百货	4,146	119,819.40	0.27
130	002714	牧原股份	1,545	119,119.50	0.26
131	603589	口子窖	1,726	118,921.40	0.26
132	000887	中鼎股份	10,145	118,797.95	0.26
133	600160	巨化股份	14,549	117,992.39	0.26
134	002422	科伦药业	6,058	117,767.52	0.26
135	000938	紫光股份	5,720	116,974.00	0.26
136	000829	天音控股	17,610	116,226.00	0.26
137	601878	浙商证券	7,576	115,912.80	0.26
138	300070	碧水源	15,103	115,537.95	0.26
139	002091	江苏国泰	15,904	114,985.92	0.26
140	600875	东方电气	11,505	114,704.85	0.26
141	600761	安徽合力	8,064	114,508.80	0.25

142	002572	索菲亚	4,405	114,089.50	0.25
143	600742	一汽富维	11,346	113,913.84	0.25
144	000926	福星股份	22,608	113,718.24	0.25
145	002048	宁波华翔	7,286	113,443.02	0.25
146	000627	天茂集团	22,872	111,386.64	0.25
147	600959	江苏有线	33,516	110,937.96	0.25
148	600308	华泰股份	21,356	110,624.08	0.25
149	002050	三花智控	4,451	109,717.15	0.24
150	300760	迈瑞医疗	257	109,482.00	0.24
151	000600	建投能源	19,491	109,344.51	0.24
152	600502	安徽建工	28,693	108,459.54	0.24
153	600006	东风汽车	11,452	108,106.88	0.24
154	600879	航天电子	14,378	107,547.44	0.24
155	002673	西部证券	10,578	107,260.92	0.24
156	601611	中国核建	14,713	107,110.64	0.24
157	600863	内蒙华电	41,587	106,878.59	0.24
158	000902	新洋丰	6,675	106,800.00	0.24
159	002563	森马服饰	10,658	106,793.16	0.24
160	002589	瑞康医药	20,383	106,603.09	0.24
161	600801	华新水泥	5,141	106,058.83	0.24
162	000528	柳工	14,300	105,248.00	0.23
163	600908	无锡银行	17,293	105,141.44	0.23
164	600835	上海机电	5,382	104,733.72	0.23
165	600183	生益科技	3,714	104,586.24	0.23
166	600811	东方集团	28,608	104,419.20	0.23
167	002080	中材科技	4,268	103,200.24	0.23
168	600111	北方稀土	7,820	102,363.80	0.23
169	000951	中国重汽	3,253	102,339.38	0.23
170	600649	城投控股	18,701	101,546.43	0.23
171	600058	五矿发展	13,837	101,425.21	0.23
172	600498	烽火通信	4,187	100,822.96	0.22
173	000921	海信家电	6,992	100,754.72	0.22
174	000683	远兴能源	46,081	99,534.96	0.22
175	600064	南京高科	9,666	99,269.82	0.22
176	600273	嘉化能源	10,599	97,934.76	0.22
177	000729	燕京啤酒	11,484	97,843.68	0.22
178	600004	白云机场	6,922	97,807.86	0.22
179	002294	信立泰	3,446	97,625.18	0.22
180	002128	露天煤业	8,900	97,366.00	0.22

181	601021	春秋航空	1,752	97,113.36	0.22
182	600682	南京新百	8,619	97,049.94	0.22
183	600312	平高电气	13,574	96,918.36	0.22
184	002508	老板电器	2,376	96,893.28	0.22
185	000078	海王生物	24,107	96,669.07	0.22
186	601718	际华集团	31,739	96,169.17	0.21
187	000661	长春高新	214	96,066.74	0.21
188	600489	中金黄金	10,883	95,879.23	0.21
189	000961	中南建设	10,837	95,690.71	0.21
190	600569	安阳钢铁	37,488	95,594.40	0.21
191	601222	林洋能源	12,044	95,388.48	0.21
192	002440	闰土股份	10,218	95,231.76	0.21
193	002926	华西证券	7,611	94,985.28	0.21
194	002701	奥瑞金	19,220	94,946.80	0.21
195	600623	华谊集团	16,240	94,192.00	0.21
196	600565	迪马股份	34,481	94,133.13	0.21
197	000717	韶钢松山	22,041	94,115.07	0.21
198	601098	中南传媒	9,831	93,689.43	0.21
199	000090	天健集团	15,669	93,073.86	0.21
200	000860	顺鑫农业	1,281	92,923.74	0.21
201	600597	光明乳业	5,712	92,877.12	0.21
202	600380	健康元	6,665	92,710.15	0.21
203	000028	国药一致	2,022	92,607.60	0.21
204	600269	赣粤高速	26,996	92,326.32	0.21
205	600708	光明地产	36,023	91,858.65	0.20
206	600713	南京医药	20,615	91,736.75	0.20
207	600038	中直股份	1,456	91,305.76	0.20
208	600138	中青旅	8,884	91,149.84	0.20
209	000877	天山股份	6,027	91,007.70	0.20
210	600415	小商品城	16,395	90,336.45	0.20
211	600827	百联股份	6,184	90,286.40	0.20
212	300146	汤臣倍健	3,731	90,103.65	0.20
213	002085	万丰奥威	13,689	89,799.84	0.20
214	000016	深康佳 A	13,562	89,644.82	0.20
215	600388	龙净环保	9,970	88,533.60	0.20
216	600515	海航基础	13,108	88,479.00	0.20
217	601179	中国西电	19,141	88,240.01	0.20
218	603369	今世缘	1,533	87,963.54	0.20
219	600694	大商股份	4,333	87,959.90	0.20

220	600373	中文传媒	8,716	87,944.44	0.20
221	002157	正邦科技	5,155	87,841.20	0.20
222	002745	木林森	6,012	87,715.08	0.20
223	600335	国机汽车	17,514	87,044.58	0.19
224	000977	浪潮信息	3,236	86,983.68	0.19
225	600580	卧龙电驱	5,574	86,954.40	0.19
226	600737	中粮糖业	8,969	86,819.92	0.19
227	600141	兴发集团	7,833	86,397.99	0.19
228	600803	新奥股份	6,357	86,391.63	0.19
229	600598	北大荒	4,486	86,355.50	0.19
230	002230	科大讯飞	2,108	86,153.96	0.19
231	600123	兰花科创	14,927	85,531.71	0.19
232	000559	万向钱潮	15,939	85,273.65	0.19
233	600482	中国动力	4,750	85,120.00	0.19
234	601588	北辰实业	37,283	85,005.24	0.19
235	002013	中航机电	7,410	84,844.50	0.19
236	600582	天地科技	27,317	84,136.36	0.19
237	600252	中恒集团	27,379	84,053.53	0.19
238	600026	中远海能	12,575	84,001.00	0.19
239	002007	华兰生物	1,987	83,930.88	0.19
240	000046	泛海控股	25,586	83,922.08	0.19
241	600073	上海梅林	8,113	83,482.77	0.19
242	002372	伟星新材	4,456	83,327.20	0.19
243	600981	汇鸿集团	27,118	82,981.08	0.18
244	600997	开滦股份	14,424	82,793.76	0.18
245	000789	万年青	6,133	81,568.90	0.18
246	000513	丽珠集团	2,013	81,526.50	0.18
247	600085	同仁堂	3,408	81,451.20	0.18
248	600395	盘江股份	10,213	80,376.31	0.18
249	002408	齐翔腾达	9,584	80,122.24	0.18
250	600691	阳煤化工	33,456	79,290.72	0.18
251	300058	蓝色光标	13,140	78,840.00	0.18
252	600973	宝胜股份	18,063	78,574.05	0.17
253	600298	安琪酵母	1,532	78,239.24	0.17
254	600566	济川药业	3,845	77,784.35	0.17
255	002203	海亮股份	10,469	77,365.91	0.17
256	002384	东山精密	2,964	77,064.00	0.17
257	600985	淮北矿业	6,877	76,953.63	0.17
258	000598	兴蓉环境	15,847	76,065.60	0.17

259	000666	经纬纺机	9,245	75,346.75	0.17
260	600017	日照港	25,897	74,583.36	0.17
261	000036	华联控股	18,694	74,402.12	0.17
262	002465	海格通信	6,834	74,012.22	0.16
263	002555	三七互娱	2,359	73,671.57	0.16
264	600612	老凤祥	1,616	73,253.28	0.16
265	600277	亿利洁能	24,453	73,114.47	0.16
266	603806	福斯特	855	73,017.00	0.16
267	002075	沙钢股份	6,626	72,687.22	0.16
268	601231	环旭电子	3,734	72,215.56	0.16
269	601872	招商轮船	12,714	71,834.10	0.16
270	600546	山煤国际	8,429	71,730.79	0.16
271	002191	劲嘉股份	7,677	70,858.71	0.16
272	600787	中储股份	15,240	70,256.40	0.16
273	600971	恒源煤电	11,134	70,032.86	0.16
274	300122	智飞生物	472	69,813.52	0.16
275	601212	白银有色	23,457	69,432.72	0.15
276	603198	迎驾贡酒	1,984	69,241.60	0.15
277	002217	合力泰	16,875	69,187.50	0.15
278	603766	隆鑫通用	19,737	69,079.50	0.15
279	000596	古井贡酒	253	68,816.00	0.15
279	600037	歌华有线	7,480	68,816.00	0.15
280	600928	西安银行	12,345	68,638.20	0.15
281	600483	福能股份	8,546	67,769.78	0.15
282	600977	中国电影	5,434	67,707.64	0.15
283	002739	万达电影	3,741	67,637.28	0.15
284	603899	晨光文具	762	67,482.72	0.15
285	300741	华宝股份	1,228	67,380.36	0.15
286	603833	欧派家居	499	67,115.50	0.15
287	000826	启迪环境	9,866	66,694.16	0.15
288	600572	康恩贝	14,152	66,655.92	0.15
289	002309	中利集团	11,584	66,260.48	0.15
290	000999	华润三九	2,654	66,190.76	0.15
291	600909	华安证券	8,268	66,144.00	0.15
292	000917	电广传媒	13,637	66,139.45	0.15
293	603885	吉祥航空	5,813	66,093.81	0.15
294	002237	恒邦股份	5,085	66,054.15	0.15
295	600233	圆通速递	5,720	65,780.00	0.15
296	600686	金龙汽车	7,566	65,067.60	0.14

297	002051	中工国际	9,144	64,830.96	0.14
298	600020	中原高速	19,089	64,711.71	0.14
299	600588	用友网络	1,461	64,094.07	0.14
300	002152	广电运通	5,945	63,492.60	0.14
301	601860	紫金银行	14,987	63,095.27	0.14
302	300003	乐普医疗	2,295	62,378.10	0.14
303	002419	天虹股份	8,157	62,319.48	0.14
304	000089	深圳机场	7,503	61,299.51	0.14
305	300144	宋城演艺	3,438	60,921.36	0.14
306	600420	现代制药	6,357	60,455.07	0.13
307	600094	大名城	14,960	60,139.20	0.13
308	002010	传化智联	12,700	59,817.00	0.13
309	601928	凤凰传媒	9,382	59,388.06	0.13
310	601886	江河集团	10,194	59,227.14	0.13
311	601163	三角轮胎	3,669	58,960.83	0.13
312	600667	太极实业	6,200	58,590.00	0.13
313	601567	三星医疗	8,754	58,214.10	0.13
314	600894	广日股份	7,147	57,747.76	0.13
315	002042	华孚时尚	12,960	57,672.00	0.13
316	002065	东华软件	6,929	57,510.70	0.13
317	002251	步步高	6,729	56,860.05	0.13
318	000030	富奥股份	7,621	55,938.14	0.12
319	002841	视源股份	482	55,444.46	0.12
320	000975	银泰黄金	6,390	55,017.90	0.12
321	002002	鸿达兴业	18,333	54,999.00	0.12
322	002624	完美世界	1,833	54,073.50	0.12
323	600062	华润双鹤	4,506	54,026.94	0.12
324	601880	大连港	27,623	53,312.39	0.12
325	600315	上海家化	1,532	53,206.36	0.12
326	000543	皖能电力	12,518	52,325.24	0.12
327	002061	浙江交科	10,056	52,190.64	0.12
328	600120	浙江东方	8,729	52,112.13	0.12
329	002948	青岛银行	8,778	52,053.54	0.12
330	600748	上实发展	10,579	51,942.89	0.12
331	002503	搜于特	23,077	51,692.48	0.11
332	600491	龙元建设	9,850	51,515.50	0.11
333	600968	海油发展	21,539	51,478.21	0.11
334	002032	苏泊尔	658	51,317.42	0.11
335	000537	广宇发展	8,184	51,313.68	0.11

336	000723	美锦能源	7,566	50,540.88	0.11
337	600648	外高桥	3,609	50,417.73	0.11
338	603816	顾家家居	713	50,273.63	0.11
339	600126	杭钢股份	9,420	49,831.80	0.11
340	300033	同花顺	397	49,220.06	0.11
341	002120	韵达股份	3,110	48,827.00	0.11
342	603328	依顿电子	6,137	48,789.15	0.11
343	600745	闻泰科技	489	48,411.00	0.11
344	000869	张裕 A	1,091	47,567.60	0.11
345	002831	裕同科技	1,541	47,185.42	0.10
346	000021	深科技	2,478	47,106.78	0.10
347	600989	宝丰能源	4,008	46,893.60	0.10
348	601808	中海油服	3,641	46,495.57	0.10
349	002267	陕天然气	7,183	46,474.01	0.10
350	002602	世纪华通	6,329	44,999.19	0.10
351	600093	易见股份	5,559	44,527.59	0.10
352	002939	长城证券	3,450	44,401.50	0.10
353	600295	鄂尔多斯	4,216	43,930.72	0.10
354	300251	光线传媒	3,591	43,343.37	0.10
355	600675	中华企业	12,874	43,256.64	0.10
356	002302	西部建设	4,817	42,293.26	0.09
357	000564	供销大集	16,295	42,204.05	0.09
358	600673	东阳光	8,328	41,889.84	0.09
359	600008	首创股份	14,745	41,728.35	0.09
360	601298	青岛港	6,391	41,094.13	0.09
361	601333	广深铁路	18,272	40,563.84	0.09
362	600548	深高速	4,384	38,929.92	0.09
363	601958	金钼股份	6,219	38,619.99	0.09
364	600901	江苏租赁	6,847	37,726.97	0.08
365	002468	申通快递	3,688	37,175.04	0.08
366	000990	诚志股份	3,134	37,169.24	0.08
367	000967	盈峰环境	4,551	37,045.14	0.08
368	601139	深圳燃气	5,101	36,931.24	0.08
369	000950	重药控股	6,969	36,238.80	0.08
370	000987	越秀金控	2,471	35,977.76	0.08
371	000156	华数传媒	4,032	34,513.92	0.08
372	601515	东风股份	5,979	33,661.77	0.07
373	603056	德邦股份	2,634	33,425.46	0.07
374	000553	安道麦 A	4,102	32,077.64	0.07

375	000800	一汽解放	2,711	31,664.48	0.07
376	601360	三六零	1,975	31,027.25	0.07
377	002938	鹏鼎控股	614	30,497.38	0.07
378	603260	合盛硅业	830	27,755.20	0.06
379	603609	禾丰牧业	2,296	27,138.72	0.06
380	600299	安迪苏	2,293	26,392.43	0.06
381	000031	大悦城	5,333	23,465.20	0.05
382	002966	苏州银行	2,911	22,356.48	0.05
383	000501	鄂武商 A	1,843	21,470.95	0.05
384	600150	中国船舶	1,204	21,298.76	0.05
385	600871	石化油服	10,533	20,644.68	0.05
386	601068	中铝国际	4,688	16,689.28	0.04
387	000958	东方能源	3,479	16,490.46	0.04
388	002607	中公教育	464	16,300.32	0.04
389	002242	九阳股份	468	14,994.72	0.03
390	601698	中国卫通	539	9,777.46	0.02
391	002311	海大集团	105	6,877.50	0.02
392	000785	居然之家	623	5,226.97	0.01
393	000413	东旭光电	1,800	4,608.00	0.01
394	601216	君正集团	893	4,420.35	0.01

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内没有买入股票

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600157	ST 永泰	173,810.84	0.39
2	600418	江淮汽车	101,440.00	0.23
3	000961	中南建设	79,200.00	0.18
4	000501	鄂武商 A	76,307.00	0.17
5	300226	上海钢联	61,500.00	0.14
6	000543	皖能电力	50,040.00	0.11
7	000031	大悦城	48,027.17	0.11
8	002091	江苏国泰	47,160.00	0.10
9	000413	东旭光电	4,608.00	0.01

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	-
卖出股票收入（成交）总额	642,093.01

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的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。

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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,389.89

8.12.4 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。

8.12.5 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。

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。

§ 8 投资组合报告（转型前）

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	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

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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	25,391,811.36	54.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,164,352.49	2.49
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

0	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

8.2.2 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。

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

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	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
11	600426	华鲁恒升	7,760	289,448.00	0.62
12	000488	晨鸣纸业	41,584	286,929.60	0.61
13	000878	云南铜业	16,312	259,034.56	0.55
14	600739	辽宁成大	11,158	258,642.44	0.55
15	000983	西山煤电	43,490	253,546.70	0.54
16	601636	旗滨集团	18,646	247,618.88	0.53
17	002078	太阳纸业	14,786	244,412.58	0.52
18	601555	东吴证券	23,947	243,301.52	0.52
19	002475	立讯精密	4,589	237,159.52	0.51
20	600109	国金证券	13,107	234,615.30	0.50
21	000786	北新建材	5,548	230,242.00	0.49
22	600325	华发股份	35,433	229,251.51	0.49
23	600873	梅花生物	39,725	223,651.75	0.48
24	600418	江淮汽车	21,121	222,826.55	0.48
25	600522	中天科技	19,764	221,356.80	0.47

26	600893	航发动力	5,233	221,251.24	0.47
27	000963	华东医药	7,235	219,509.90	0.47
28	000059	华锦股份	35,880	217,432.80	0.46
29	600039	四川路桥	40,559	212,934.75	0.46
30	300226	上海钢联	3,350	212,859.00	0.46
31	600348	阳泉煤业	36,870	209,052.90	0.45
32	002001	新和成	6,261	206,487.78	0.44
33	000768	中航飞机	6,868	206,040.00	0.44
34	002183	怡亚通	41,874	206,020.08	0.44
35	300059	东方财富	7,734	203,713.56	0.44
36	600584	长电科技	4,723	202,380.55	0.43
37	000581	威孚高科	7,614	202,151.70	0.43
38	000961	中南建设	19,837	196,783.04	0.42
39	300124	汇川技术	2,279	192,393.18	0.41
40	002221	东华能源	15,937	190,765.89	0.41
41	002081	金螳螂	17,108	190,754.20	0.41
42	601901	方正证券	20,112	185,633.76	0.40
43	600100	同方股份	26,716	183,806.08	0.39
44	600157	*ST 永泰	122,402	183,603.00	0.39
45	600516	方大炭素	26,036	183,293.44	0.39
46	000423	东阿阿胶	4,194	183,277.80	0.39
47	000060	中金岭南	34,234	182,809.56	0.39
48	600266	城建发展	31,442	182,049.18	0.39
49	002236	大华股份	8,429	180,549.18	0.39
50	600143	金发科技	10,707	178,271.55	0.38
51	600208	新潮中宝	53,099	174,695.71	0.37
52	601128	常熟银行	22,825	174,383.00	0.37
53	601717	郑煤机	14,801	174,355.78	0.37
54	000540	中天金融	54,617	173,682.06	0.37
55	601108	财通证券	13,266	173,386.62	0.37
56	000623	吉林敖东	9,719	171,443.16	0.37
57	600567	山鹰国际	49,430	170,533.50	0.36
58	600699	均胜电子	6,533	169,988.66	0.36
59	000728	国元证券	19,098	169,972.20	0.36
60	000401	冀东水泥	10,284	169,583.16	0.36
61	000960	锡业股份	15,212	169,005.32	0.36
62	600079	人福医药	4,724	168,883.00	0.36
63	600535	天士力	9,702	167,456.52	0.36
64	600881	亚泰集团	50,971	167,184.88	0.36

65	000933	神火股份	19,577	165,817.19	0.35
66	601699	潞安环能	23,465	161,673.85	0.35
67	600497	驰宏锌锗	32,693	161,503.42	0.35
68	600528	中铁工业	17,023	161,037.58	0.34
69	002244	滨江集团	31,387	160,387.57	0.34
70	600061	国投资本	10,732	159,155.56	0.34
71	600859	王府井	4,441	158,543.70	0.34
72	600970	中材国际	21,297	157,810.77	0.34
73	300072	三聚环保	21,830	157,176.00	0.34
74	600369	西南证券	29,249	156,189.66	0.33
75	002271	东方雨虹	4,164	155,816.88	0.33
76	601058	赛轮轮胎	24,457	155,546.52	0.33
77	002091	江苏国泰	21,904	154,861.28	0.33
78	000034	神州数码	6,272	152,535.04	0.33
79	601866	中远海发	47,869	152,223.42	0.33
80	600711	盛屯矿业	21,320	152,011.60	0.33
81	000807	云铝股份	17,270	151,112.50	0.32
82	600466	蓝光发展	28,620	148,537.80	0.32
83	600060	海信视像	12,990	148,215.90	0.32
84	601666	平煤股份	23,962	148,085.16	0.32
85	300433	蓝思科技	4,787	147,822.56	0.32
86	600487	亨通光电	9,794	147,791.46	0.32
87	600390	五矿资本	20,478	147,646.38	0.32
88	002416	爱施德	17,000	144,840.00	0.31
89	000887	中鼎股份	10,145	144,160.45	0.31
90	603156	养元饮品	5,432	144,056.64	0.31
91	300207	欣旺达	5,024	143,686.40	0.31
92	002456	欧菲光	9,152	142,954.24	0.31
93	600583	海油工程	30,051	142,742.25	0.31
94	002008	大族激光	3,473	141,524.75	0.30
95	000690	宝新能源	18,500	141,155.00	0.30
96	600710	苏美达	24,808	140,413.28	0.30
97	600664	哈药股份	42,345	139,315.05	0.30
98	600056	中国医药	8,931	138,519.81	0.30
99	002233	塔牌集团	9,719	138,495.75	0.30
100	600256	广汇能源	44,677	138,051.93	0.30
101	000591	太阳能	28,200	137,334.00	0.29
102	603858	步长制药	5,696	137,330.56	0.29
103	002004	华邦健康	24,237	136,939.05	0.29

104	002385	大北农	16,684	136,641.96	0.29
105	000066	中国长城	9,132	136,614.72	0.29
106	601000	唐山港	51,642	136,334.88	0.29
107	600742	一汽富维	11,346	136,152.00	0.29
108	000550	江铃汽车	6,286	135,651.88	0.29
109	002422	科伦药业	6,058	135,214.56	0.29
110	600884	杉杉股份	9,289	133,111.37	0.28
111	600801	华新水泥	5,141	132,380.75	0.28
112	601198	东兴证券	9,915	131,076.30	0.28
113	000050	深天马 A	8,725	130,700.50	0.28
114	000829	天音控股	17,610	130,490.10	0.28
115	000012	南玻 A	17,264	130,343.20	0.28
116	002572	索菲亚	4,405	129,727.25	0.28
117	600729	重庆百货	4,146	129,603.96	0.28
118	000938	紫光股份	5,720	129,043.20	0.28
119	300070	碧水源	15,103	128,224.47	0.27
120	600761	安徽合力	8,064	126,927.36	0.27
121	600717	天津港	25,834	126,586.60	0.27
122	600308	华泰股份	21,356	125,573.28	0.27
123	002048	宁波华翔	7,286	124,663.46	0.27
124	000951	中国重汽	3,253	124,329.66	0.27
125	600600	青岛啤酒	1,335	124,288.50	0.27
126	601878	浙商证券	7,576	124,019.12	0.27
127	600307	酒钢宏兴	73,713	123,837.84	0.26
128	002958	青农商行	25,366	123,532.42	0.26
129	600959	江苏有线	33,516	123,338.88	0.26
130	300408	三环集团	3,843	122,476.41	0.26
131	002299	圣农发展	4,805	122,143.10	0.26
132	000686	东北证券	12,311	122,002.01	0.26
133	600875	东方电气	11,505	121,377.75	0.26
134	002500	山西证券	15,026	120,809.04	0.26
135	000926	福星股份	22,608	120,726.72	0.26
136	601966	玲珑轮胎	3,692	120,543.80	0.26
137	600096	云天化	20,810	119,865.60	0.26
138	600160	巨化股份	14,549	119,447.29	0.26
139	000750	国海证券	21,492	119,280.60	0.26
140	600335	国机汽车	17,514	118,744.92	0.25
141	600502	安徽建工	28,693	117,641.30	0.25
142	600754	锦江酒店	2,396	117,404.00	0.25

143	002701	奥瑞金	19,220	117,049.80	0.25
144	000627	天茂集团	22,872	116,875.92	0.25
145	000921	海信家电	6,992	116,486.72	0.25
146	600511	国药股份	2,714	116,484.88	0.25
147	002589	瑞康医药	20,383	115,571.61	0.25
148	000600	建投能源	19,491	113,632.53	0.24
149	600811	东方集团	28,608	113,573.76	0.24
150	002129	中环股份	4,941	113,050.08	0.24
151	600273	嘉化能源	10,599	112,985.34	0.24
152	600549	厦门钨业	7,166	112,362.88	0.24
153	002050	三花智控	4,451	111,764.61	0.24
154	600835	上海机电	5,382	111,407.40	0.24
155	002714	牧原股份	1,545	111,240.00	0.24
156	603589	口子窖	1,726	111,171.66	0.24
157	000559	万向钱潮	15,939	111,094.83	0.24
158	601611	中国核建	14,713	110,936.02	0.24
159	002075	沙钢股份	6,626	110,654.20	0.24
160	600863	内蒙华电	41,587	110,621.42	0.24
161	000528	柳工	14,300	110,110.00	0.24
162	000877	天山股份	6,027	109,992.75	0.24
163	000090	天健集团	15,669	109,683.00	0.23
164	002085	万丰奥威	13,689	109,238.22	0.23
165	000683	远兴能源	46,081	108,751.16	0.23
166	000501	鄂武商 A	7,843	108,625.55	0.23
167	002128	露天煤业	8,900	108,313.00	0.23
168	002340	格林美	20,902	108,272.36	0.23
169	002936	郑州银行	29,125	108,053.75	0.23
170	000717	韶钢松山	22,041	107,780.49	0.23
171	600141	兴发集团	7,833	107,233.77	0.23
172	600489	中金黄金	10,883	107,197.55	0.23
173	601098	中南传媒	9,831	106,469.73	0.23
174	600058	五矿发展	13,837	106,129.79	0.23
175	002440	闰土股份	10,218	106,062.84	0.23
176	600498	烽火通信	4,187	106,056.71	0.23
177	300015	爱尔眼科	1,642	106,023.94	0.23
178	600623	华谊集团	16,240	105,072.80	0.22
179	600373	中文传媒	8,716	103,981.88	0.22
180	601718	际华集团	31,739	103,786.53	0.22
181	600388	龙净环保	9,970	103,588.30	0.22

182	600649	城投控股	18,701	103,229.52	0.22
183	002508	老板电器	2,376	103,118.40	0.22
184	603259	药明康德	958	102,985.00	0.22
185	600694	大商股份	4,333	102,518.78	0.22
186	600004	白云机场	6,922	102,445.60	0.22
187	000729	燕京啤酒	11,484	102,437.28	0.22
188	000543	皖能电力	24,518	101,994.88	0.22
189	000028	国药一致	2,022	101,807.70	0.22
190	600565	迪马股份	34,481	101,374.14	0.22
191	000046	泛海控股	25,586	100,808.84	0.22
192	600064	南京高科	9,666	100,526.40	0.21
193	002673	西部证券	10,578	100,279.44	0.21
194	000078	海王生物	24,107	100,044.05	0.21
195	600380	健康元	6,665	99,908.35	0.21
196	000789	万年青	6,133	99,906.57	0.21
197	600111	北方稀土	7,820	99,470.40	0.21
198	000902	新洋丰	6,675	99,457.50	0.21
199	600908	无锡银行	17,293	99,434.75	0.21
200	603799	华友钴业	1,829	99,406.15	0.21
201	600879	航天电子	14,378	98,920.64	0.21
202	600183	生益科技	3,714	98,903.82	0.21
203	600708	光明地产	36,023	98,342.79	0.21
204	300146	汤臣倍健	3,731	96,409.04	0.21
205	002926	华西证券	7,611	96,279.15	0.21
206	002294	信立泰	3,446	96,143.40	0.21
207	600138	中青旅	8,884	95,325.32	0.20
208	600269	赣粤高速	26,996	95,295.88	0.20
209	002042	华孚时尚	12,960	94,608.00	0.20
210	600713	南京医药	20,615	94,416.70	0.20
211	600809	山西汾酒	352	93,952.32	0.20
212	600312	平高电气	13,574	93,796.34	0.20
213	601588	北辰实业	37,283	93,207.50	0.20
214	000513	丽珠集团	2,013	93,161.64	0.20
215	002563	森马服饰	10,658	92,937.76	0.20
216	600085	同仁堂	3,408	92,936.16	0.20
217	002157	正邦科技	5,155	92,583.80	0.20
218	600682	南京新百	8,619	92,568.06	0.20
219	000977	浪潮信息	3,236	92,226.00	0.20
220	600515	海航基础	13,108	91,887.08	0.20

221	002745	木林森	6,012	91,803.24	0.20
222	600803	新奥股份	6,357	91,413.66	0.20
223	002372	伟星新材	4,456	91,392.56	0.20
224	600582	天地科技	27,317	91,238.78	0.20
225	601222	林洋能源	12,044	91,173.08	0.19
226	002408	齐翔腾达	9,584	91,143.84	0.19
227	000016	深康佳 A	13,562	91,001.02	0.19
228	600026	中远海能	12,575	90,917.25	0.19
229	600981	汇鸿集团	27,118	90,574.12	0.19
230	601021	春秋航空	1,752	89,965.20	0.19
231	300760	迈瑞医疗	257	89,564.50	0.19
232	600252	中恒集团	27,379	89,529.33	0.19
233	600597	光明乳业	5,712	89,050.08	0.19
234	002203	海亮股份	10,469	88,986.50	0.19
235	300058	蓝色光标	13,140	88,563.60	0.19
236	600415	小商品城	16,395	87,549.30	0.19
237	002230	科大讯飞	2,108	86,638.80	0.19
238	600569	安阳钢铁	37,488	86,597.28	0.19
239	601179	中国西电	19,141	85,943.09	0.18
240	600566	济川药业	3,845	85,589.70	0.18
241	600123	兰花科创	14,927	85,233.17	0.18
242	600827	百联股份	6,184	85,215.52	0.18
243	600997	开滦股份	14,424	84,957.36	0.18
244	002080	中材科技	4,268	84,890.52	0.18
245	002007	华兰生物	1,987	84,447.50	0.18
246	000598	兴蓉环境	15,847	82,721.34	0.18
247	600482	中国动力	4,750	82,412.50	0.18
248	600277	亿利洁能	24,453	82,162.08	0.18
249	600073	上海梅林	8,113	81,941.30	0.18
250	600973	宝胜股份	18,063	81,464.13	0.17
251	603766	隆鑫通用	19,737	81,316.44	0.17
252	600985	淮北矿业	6,877	81,286.14	0.17
253	002465	海格通信	6,834	81,187.92	0.17
254	601231	环旭电子	3,734	80,915.78	0.17
255	600612	老凤祥	1,616	80,476.80	0.17
256	000036	华联控股	18,694	80,384.20	0.17
257	600737	中粮糖业	8,969	80,272.55	0.17
258	603369	今世缘	1,533	80,267.88	0.17
259	600037	歌华有线	7,480	80,036.00	0.17

260	600006	东风汽车	11,452	79,820.44	0.17
261	000666	经纬纺机	9,245	79,691.90	0.17
262	002191	劲嘉股份	7,677	79,073.10	0.17
263	601872	招商轮船	12,714	78,953.94	0.17
264	600691	阳煤化工	33,456	78,621.60	0.17
265	600395	盘江股份	10,213	77,720.93	0.17
266	002384	东山精密	2,964	77,478.96	0.17
267	002013	中航机电	7,410	77,434.50	0.17
268	600598	北大荒	4,486	77,114.34	0.16
269	002217	合力泰	16,875	76,612.50	0.16
270	600038	中直股份	1,456	76,148.80	0.16
271	600017	日照港	25,897	76,137.18	0.16
272	000661	长春高新	214	76,096.26	0.16
273	600580	卧龙电驱	5,574	75,416.22	0.16
274	002002	鸿达兴业	18,333	75,165.30	0.16
275	600233	圆通速递	5,720	75,103.60	0.16
276	600787	中储股份	15,240	74,980.80	0.16
277	000826	启迪环境	9,866	74,685.62	0.16
278	600298	安琪酵母	1,532	74,685.00	0.16
279	000031	大悦城	15,333	74,518.38	0.16
280	002237	恒邦股份	5,085	74,190.15	0.16
281	000860	顺鑫农业	1,281	74,157.09	0.16
282	601212	白银有色	23,457	73,654.98	0.16
283	000917	电广传媒	13,637	73,230.69	0.16
284	600094	大名城	14,960	73,154.40	0.16
285	002010	传化智联	12,700	72,517.00	0.16
286	600572	康恩贝	14,152	72,458.24	0.15
287	300741	华宝股份	1,228	72,255.52	0.15
288	000999	华润三九	2,654	72,241.88	0.15
289	002419	天虹股份	8,157	71,292.18	0.15
290	600977	中国电影	5,434	70,859.36	0.15
291	002152	广电运通	5,945	70,448.25	0.15
292	002051	中工国际	9,144	69,768.72	0.15
293	002739	万达电影	3,741	68,871.81	0.15
294	600909	华安证券	8,268	68,789.76	0.15
295	603833	欧派家居	499	68,707.31	0.15
296	002251	步步高	6,729	68,703.09	0.15
297	600020	中原高速	19,089	68,147.73	0.15
298	603885	吉祥航空	5,813	68,128.36	0.15

299	300003	乐普医疗	2,295	67,541.85	0.14
300	600420	现代制药	6,357	67,257.06	0.14
301	600667	太极实业	6,200	66,960.00	0.14
302	600483	福能股份	8,546	66,915.18	0.14
303	600546	山煤国际	8,429	66,589.10	0.14
304	603198	迎驾贡酒	1,984	66,384.64	0.14
305	000089	深圳机场	7,503	66,176.46	0.14
306	601163	三角轮胎	3,669	66,005.31	0.14
307	600928	西安银行	12,345	65,551.95	0.14
308	600588	用友网络	1,461	65,423.58	0.14
309	601928	凤凰传媒	9,382	64,923.44	0.14
310	300144	宋城演艺	3,438	64,634.40	0.14
311	002065	东华软件	6,929	63,885.38	0.14
312	603806	福斯特	855	63,868.50	0.14
313	601886	江河集团	10,194	63,712.50	0.14
314	601567	三星医疗	8,754	63,554.04	0.14
315	600686	金龙汽车	7,566	63,251.76	0.14
316	600894	广日股份	7,147	63,250.95	0.14
317	002309	中利集团	11,584	63,248.64	0.14
318	000030	富奥股份	7,621	62,873.25	0.13
319	600971	恒源煤电	11,134	62,239.06	0.13
320	000975	银泰黄金	6,390	62,110.80	0.13
321	601860	紫金银行	14,987	61,146.96	0.13
322	600491	龙元建设	9,850	60,971.50	0.13
323	600126	杭钢股份	9,420	60,759.00	0.13
324	600315	上海家化	1,532	60,590.60	0.13
325	002555	三七互娱	2,359	60,555.53	0.13
326	603899	晨光文具	762	60,007.50	0.13
327	600120	浙江东方	8,729	59,619.07	0.13
328	300122	智飞生物	472	59,505.04	0.13
329	603816	顾家家居	713	59,179.00	0.13
330	002061	浙江交科	10,056	58,224.24	0.12
331	600062	华润双鹤	4,506	57,181.14	0.12
332	300033	同花顺	397	56,973.47	0.12
333	600748	上实发展	10,579	56,491.86	0.12
334	601880	大连港	27,623	56,074.69	0.12
335	002120	韵达股份	3,110	56,073.30	0.12
336	000537	广宇发展	8,184	55,814.88	0.12
337	000596	古井贡酒	253	55,346.28	0.12

338	000723	美锦能源	7,566	54,475.20	0.12
339	002503	搜于特	23,077	54,230.95	0.12
340	600968	海油发展	21,539	53,847.50	0.12
341	600648	外高桥	3,609	52,619.22	0.11
342	002841	视源股份	482	52,017.44	0.11
343	600745	闻泰科技	489	51,755.76	0.11
344	600989	宝丰能源	4,008	51,502.80	0.11
345	603328	依顿电子	6,137	51,121.21	0.11
346	000021	深科技	2,478	50,724.66	0.11
347	600675	中华企业	12,874	49,693.64	0.11
348	601808	中海油服	3,641	49,663.24	0.11
349	002602	世纪华通	6,329	49,556.07	0.11
350	002267	陕天然气	7,183	49,203.55	0.11
351	600093	易见股份	5,559	48,196.53	0.10
352	600673	东阳光	8,328	47,886.00	0.10
353	002032	苏泊尔	658	47,639.20	0.10
354	000564	供销大集	16,295	47,418.45	0.10
355	002468	申通快递	3,688	47,132.64	0.10
356	002624	完美世界	1,833	47,108.10	0.10
357	002302	西部建设	4,817	46,917.58	0.10
358	600295	鄂尔多斯	4,216	46,544.64	0.10
359	002831	裕同科技	1,541	46,522.79	0.10
360	600008	首创股份	14,745	45,562.05	0.10
361	002939	长城证券	3,450	45,436.50	0.10
362	300251	光线传媒	3,591	44,959.32	0.10
363	002948	青岛银行	8,778	43,977.78	0.09
364	601333	广深铁路	18,272	43,670.08	0.09
365	000869	张裕 A	1,091	42,734.47	0.09
366	000990	诚志股份	3,134	42,528.38	0.09
367	000967	盈峰环境	4,551	41,050.02	0.09
368	000987	越秀金控	2,471	40,796.21	0.09
369	601139	深圳燃气	5,101	40,195.88	0.09
370	600901	江苏租赁	6,847	39,986.48	0.09
371	600548	深高速	4,384	39,982.08	0.09
372	601958	金钼股份	6,219	39,863.79	0.09
373	601298	青岛港	6,391	39,752.02	0.08
374	000156	华数传媒	4,032	39,634.56	0.08
375	000950	重药控股	6,969	38,120.43	0.08
376	601515	东风股份	5,979	36,950.22	0.08

377	603056	德邦股份	2,634	36,191.16	0.08
378	000800	一汽解放	2,711	35,568.32	0.08
379	000553	安道麦 A	4,102	34,743.94	0.07
380	603260	合盛硅业	830	33,590.10	0.07
381	600299	安迪苏	2,293	31,849.77	0.07
382	002938	鹏鼎控股	614	30,429.84	0.07
383	601360	三六零	1,975	29,921.25	0.06
384	603609	禾丰牧业	2,296	29,182.16	0.06
385	600150	中国船舶	1,204	22,550.92	0.05
386	002966	苏州银行	2,911	22,531.14	0.05
387	600871	石化油服	10,533	19,802.04	0.04
388	601068	中铝国际	4,688	18,752.00	0.04
389	002607	中公教育	464	17,956.80	0.04
390	002242	九阳股份	468	16,450.20	0.04
391	000958	东方能源	3,479	15,411.97	0.03
392	601698	中国卫通	539	10,510.50	0.02
393	000413	东旭光电	3,600	9,324.00	0.02
394	002311	海大集团	105	6,318.90	0.01
395	000785	居然之家	623	5,326.65	0.01
396	601216	君正集团	893	5,107.96	0.01

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	600827	百联股份	353,010.00	0.77
2	000413	东旭光电	242,581.00	0.53
3	000540	中天金融	192,735.00	0.42
4	600208	新湖中宝	190,315.00	0.42
5	002422	科伦药业	188,553.00	0.41
6	600060	海信视像	188,524.00	0.41
7	600498	烽火通信	186,229.00	0.41
8	600583	海油工程	163,872.00	0.36
9	600061	国投资本	151,026.00	0.33
10	600893	航发动力	146,147.00	0.32
11	601128	常熟银行	145,190.00	0.32

12	600390	五矿资本	135,469.00	0.30
13	600710	苏美达	134,220.00	0.29
14	000732	泰禾集团	129,159.00	0.28
15	002958	青农商行	127,998.00	0.28
16	600863	内蒙华电	124,013.00	0.27
17	601333	广深铁路	123,401.00	0.27
18	000938	紫光股份	120,539.00	0.26
19	002936	郑州银行	119,587.00	0.26
20	002555	三七互娱	114,061.00	0.25

8.4.2 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	600276	恒瑞医药	410,699.00	0.90
2	000413	东旭光电	377,473.93	0.83
3	002241	歌尔股份	348,434.14	0.76
4	600827	百联股份	339,321.00	0.74
5	601216	君正集团	330,643.12	0.73
6	600143	金发科技	318,895.43	0.70
7	002475	立讯精密	302,291.07	0.66
8	000425	徐工机械	290,517.36	0.64
9	600584	长电科技	284,411.04	0.62
10	002311	海大集团	267,720.43	0.59
11	600418	江淮汽车	255,593.20	0.56
12	000732	泰禾集团	244,603.84	0.54
13	600859	王府井	242,593.18	0.53
14	601333	广深铁路	227,967.45	0.50
15	600546	山煤国际	218,618.41	0.48
16	600079	人福医药	202,683.61	0.44
17	600498	烽火通信	199,873.31	0.44
18	600185	格力地产	191,400.00	0.42
19	002456	欧菲光	184,983.90	0.41
20	600804	鹏博士	159,384.24	0.35

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	13,217,258.82
卖出股票收入（成交）总额	20,292,618.49

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的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。

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	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
8	其他	-
9	合计	18,428.99

8.12.4 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。

8.12.5 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。

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（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
674	57,703.02	35,129,525.73	90.33%	3,762,312.53	9.67%

9.2 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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

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	-	-	-	-	-	-
泰信基本面 400B	-	-	-	-	-	-
泰信基本面 400	700	56,354.08	35,129,525.73	89.05%	4,318,333.74	10.95%
合计	700	56,354.08	35,129,513.73	89.05%	4,318,333.74	10.95%

9.2 期末上市基金前十名持有人

截至报告期末，本基金无上市份额。

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。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	39,447,859.47
本报告期期初基金份额总额	-
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(份额减少以"-"填列)	-1.00
本报告期期末基金份额总额	38,891,838.26

§ 10 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
基金转型日（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	1,022,305.00	1,022,305.00	45,660,625.30
本报告期基金总申购份额	-	-	2,490,877.54
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	-9,858,894.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-1,022,305.00	-1,022,305.00	1,155,252.57
本报告期期末基金份额总额	0.00	0.00	39,447,860.47

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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。

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

1、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2020 年 4 月 22 日起，高宇先生担任公司总经理职务，葛航先生不再担任公司总经理职务。具体详情参见 2020 年 4 月 23 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

2、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2020 年 5 月 14 日起，桑维英女士不再担任公司副总经理职务；韩波先生不再担任公司副总经理、首席信息官职务。具体详情参见 2020 年 5 月 15 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰

信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

3、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2020 年 6 月 2 日起，岳红婷女士担任公司副总经理职务。具体详情参见 2020 年 6 月 2 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

4、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2020 年 7 月 2 日起，总经理高宇先生代任公司督察长职务，吴胜光先生不再担任公司督察长职务。具体详情参见 2020 年 7 月 3 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

5、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2020 年 9 月 21 日起，叶振宇先生担任公司首席信息官职务。具体详情参见 2020 年 9 月 22 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

6、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2020 年 10 月 20 日起，张秉麟先生担任公司副总经理职务。具体详情参见 2020 年 10 月 20 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

本公司上述人事变动已按相关规定进行备案。

本报告期基金托管人的专门基金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

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。

本基金投资策略：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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

依据泰信基金管理有限公司第五届董事会 2020 年第八次会议决议、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、各基金《基金合同》及《招募说明书》等法律文件，2020 年 12 月 22 日起旗下基金改聘会计师事务所，由原普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)改聘为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。具体详情参见 2020 年 12 月 22 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站 (www.ftfund.com) 上的《泰信基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告》。

本报告期本基金支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计费为人民币 3 万元。该审计机构从会计师事务所改聘公告日起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(转型后)

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
广发证券	2	366,842.17	57.13%	334.30	56.60%	-
华泰证券	1	275,250.84	42.87%	256.34	43.40%	-
中国银河证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	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：东方财富证券 009655，开源证券 46940，西部证券 47718；退租交易单元：中山证券 395432。

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
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
广发证券	2	14,918,545.72	44.58%	13,595.33	44.04%	-
川财证券	1	13,334,603.55	39.84%	12,418.38	40.23%	-
华泰证券	1	5,213,412.04	15.58%	4,855.42	15.73%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证 券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 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：东方财富证券 009655，开源证券 46940，西部证券 47718；退租交易

单元：中山证券 395432。

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
广发证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰信基本面 400 指数基金 (LOF) 开放暂停申购、赎回、定投、转托管业务	《证券时报》及规定网站	2020 年 11 月 24 日
2	泰信基本面 400 指数分级基金暂停申购、赎回、定投	《证券时报》及规定网站	2020 年 11 月 24 日
3	新增通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 12 月 15 日
4	参加宁波银行股份有限公司同业基金销售平台基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 12 月 15 日
5	改聘会计师事务所公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 12 月 22 日
6	参加工商银行申购费率优惠业务	《证券时报》及规定网站	2020 年 12 月 23 日
7	新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务及参加其申购费率优惠	《证券时报》及规定网站	2020 年 12 月 24 日
8	新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其申购费率优惠活动	《证券时报》及规定网站	2020 年 12 月 30 日

11.9 其他重大事件（转型前）

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》及规定网站	2020 年 1 月 3 日
2	泰信 400A 份额第九个运作周年约定收益率的公告	《证券时报》及规定网站	2020 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	《证券时报》及规定网站	2020 年 1 月 6 日

	告		
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》及规定网站	2020 年 1 月 6 日
5	2019 年 4 季度报告	《证券时报》及规定网站	2020 年 1 月 20 日
6	泰信 400B 份额溢价风险提示 公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 2 月 4 日
7	泰信 400B 份额溢价风险提示 公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 2 月 6 日
8	泰信 400B 份额溢价风险提示 公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 2 月 8 日
9	泰信 400B 份额溢价风险提示 公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 2 月 12 日
10	在华安证券开通转换、定投及 申购费率优惠活动的公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 2 月 17 日
11	泰信 400B 份额溢价风险提示 公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 2 月 17 日
12	泰信 400B 份额溢价风险提示 公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 2 月 20 日
13	泰信 400B 份额溢价风险提示 公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 3 月 2 日
14	投资者使用港澳台居民居住证 办理开放式基金相关业务的公 告	《证券时报》及规定网站	2020 年 3 月 5 日
15	新增中信建投证券股份有限公 司为销售机构并开通转换、定 投业务及参加其申购费率优惠 活动的公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 3 月 6 日
16	修改基金合同、托管协议公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 3 月 13 日
17	新增大连网金基金销售有限公 司为销售机构并开通转换定投 并参加申购费率优惠业务	《证券时报》及规定网站	2020 年 3 月 16 日
18	泰信 400B 份额溢价风险提示 公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 3 月 17 日
19	停牌股票估值调整(浪潮信息)	《证券时报》及规定网站	2020 年 3 月 17 日
20	泰信 400B 份额溢价风险提示 公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 3 月 19 日
21	新增江苏汇淋保大基金销售有 限公司为销售机构并开通定投 及费率优惠业务公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 3 月 30 日
22	泰信 400B 份额溢价风险提示 公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 4 月 7 日
23	新增北京汇成基金销售有限公 司为销售并开通转换、定投及 费率优惠业务公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 4 月 10 日

24	暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》及规定网站	2020年4月16日
25	2020年1季度报告	《证券时报》及规定网站	2020年4月21日
26	基金行业高级管理人员变更公告	《证券时报》及规定网站	2020年4月23日
27	参加中信证券华南股份有限公司申购费率优惠	《证券时报》及规定网站	2020年4月27日
28	2019年度报告	《证券时报》及规定网站	2020年4月29日
29	基金行业高级管理人员变更公告	《证券时报》及规定网站	2020年5月15日
30	新增上海挖财基金销售有限公司为销售机构并开通转换定投费率优惠业务公告	《证券时报》及规定网站	2020年5月19日
31	在申万宏源证券开通转换、定投并参加费率优惠活动	《证券时报》及规定网站	2020年5月20日
32	开放式基金参加汇成基金申购费率及转换费用优惠活动	《证券时报》及规定网站	2020年5月28日
33	高级管理人员变更的公告	《证券时报》及规定网站	2020年6月2日
34	新增恒泰证券为销售机构并开通转换定投费率优惠	《证券时报》及规定网站	2020年6月15日
35	公司直销柜台费率优惠	《证券时报》及规定网站	2020年6月17日
36	新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加申购费率优惠活动	《证券时报》及规定网站	2020年7月2日
37	参加平安银行申购定投费率优惠	《证券时报》及规定网站	2020年7月14日
38	2020年2季度报告	《证券时报》及规定网站	2020年7月20日
39	参加中国银行申购定投费率优惠活动	《证券时报》及规定网站	2020年8月24日
40	网上交易系统暂停部分基金交易业务	《证券时报》及规定网站	2020年8月27日
41	2020年中期报告	《证券时报》及规定网站	2020年8月28日
42	产品资料概要更新	《证券时报》及规定网站	2020年8月31日
43	公司服务热线服务时间调整	《证券时报》及规定网站	2020年9月5日
44	通讯方式召开持有人大会公告	《证券时报》及规定网站	2020年9月10日
45	通讯方式召开持有人大会公告业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020年9月10日
46	通讯方式召开持有人大会公告第一次提示性公告	《证券时报》及规定网站	2020年9月11日
47	通讯方式召开持有人大会公告业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020年9月11日

48	通讯方式召开持有人大会公告 第二次提示性公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 14 日
49	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 14 日
50	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 15 日
51	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 16 日
52	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 17 日
53	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 18 日
54	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 21 日
55	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 22 日
56	高级管理人员变更的公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 22 日
57	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 23 日
58	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 24 日
59	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 25 日
60	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 28 日
61	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 29 日
62	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 9 月 30 日
63	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 9 日
64	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 12 日
65	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 13 日
66	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 14 日
67	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 15 日
68	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 16 日
69	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 19 日
70	通讯方式召开持有人大会公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 20 日

	业务提示公告		
71	高级管理人员变更的公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 20 日
72	持有人大会计票日 AB 份额停牌提示性公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 20 日
73	通讯方式召开持有人大会公告 业务提示公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 21 日
74	泰信基本面 400 指数分级基金 持有人大会决议生效公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 22 日
75	2020 年 3 季度报告	《证券时报》及规定网站	2020 年 10 月 27 日
76	泰信基本面 400 指数分级基金 转型公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 11 月 17 日
77	泰信 400A、泰信 400B 份额终 止上市公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 11 月 17 日
78	泰信 400A、泰信 400B 份额终 止上市提示性公告	《证券时报》及规定网站	2020 年 11 月 18 日
79	泰信基本面 400 指数分级基金 暂停申购、赎回、定投、转托 管业务	《证券时报》及规定网站	2020 年 11 月 18 日
80	泰信基本面 400 基金名称简称 变更	《证券时报》及规定网站	2020 年 11 月 19 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	20200101 - 20201231	18,936,790.03	479,161.07	-	19,415,951.10	49.92%
	2	20200101 - 20201231	15,322,767.78	387,714.85	-	15,710,482.63	40.40%
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，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

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)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 3 月 29 日