# 泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 26 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。本中期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 2022 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录 ..... 2**

1.1 重要提示 ..... 2
1.2 目录 ..... 3

**§2 基金简介 ..... 5**

2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 5
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6

**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6**

3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 7

**§4 管理人报告 ..... 8**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 10
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 ..... 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 ..... 13

**§5 托管人报告 ..... 14**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 14

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 14**

6.1 资产负债表 ..... 14
6.2 利润表 ..... 16
6.3 净资产（基金净值）变动表 ..... 17
6.4 报表附注 ..... 20

**§7 投资组合报告 ..... 35**

7.1 期末基金资产组合情况 ..... 35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 ..... 37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 ..... 42

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... 42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... 42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... 42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 42
7.12 投资组合报告附注 ..... 43
**§8 基金份额持有人信息 ..... 43**
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 43
8.3 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情况 ..... 44
**§9 开放式基金份额变动 ..... 44**
**§10 重大事件揭示 ..... 44**
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 ..... 44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 45
10.4 基金投资策略的改变 ..... 45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 ..... 45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 45
10.8 其他重大事件 ..... 47
**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 48**
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... 48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 48
**§12 备查文件目录 ..... 48**
12.1 备查文件目录 ..... 48
12.2 存放地点 ..... 49
12.3 查阅方式 ..... 49

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 泰信国策驱动混合 |
| 基金主代码 | 001569 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 10 月 27 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 | 104,643,001.12 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金将积极投资于受益于国家政策驱动、符合经济发展方向且具有良好成长性的优质企业，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 我国经济转型的推进与国家政策导向紧密相关，国家政策将有力推动相关经济领域的发展，受益于国家政策的行业和公司将成为先导性力量，在整体经济中占主导地位，其中蕴含的投资机会将主导未来资本市场的走向。<br>本基金将深入挖掘国家政策驱动、符合经济发展方向且确定性较高的投资机会，同时结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，注重股票资产在其各相关行业的配置，并考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产波动的风险。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%＋上证国债指数收益率×50% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 泰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 | 罗丽娟 | 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 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 | 李高峰 | 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》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.ftfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 泰信基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36、37 层 |
| 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 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -54,140,618.31 |
| 本期利润 | -30,852,321.98 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2697 |
| 本期加权平均净值利润率 | -13.97% |
| 本期基金份额净值增长率 | -10.27% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 75,758,660.85 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.7240 |
| 期末基金资产净值 | 220,257,083.65 |
| 期末基金份额净值 | 2.105 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 110.50% |

注：1、本基金基金合同于 2015 年 10 月 27 日正式生效。

2、所述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

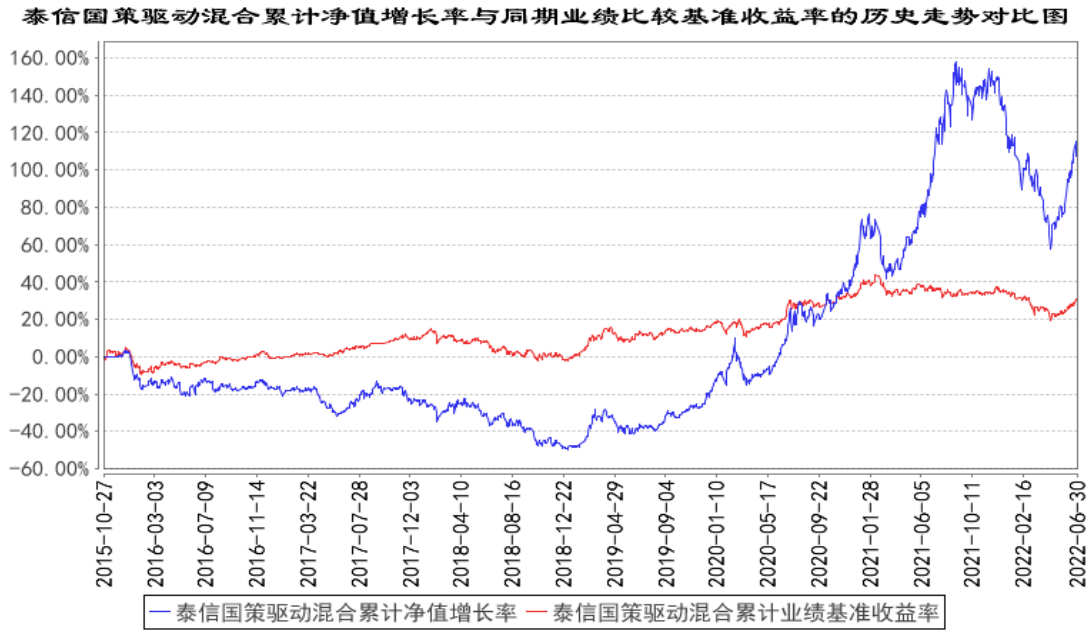
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 16.23% | 1.70% | 4.84% | 0.53% | 11.39% | 1.17% |
| 过去三个月 | 12.87% | 1.75% | 3.78% | 0.72% | 9.09% | 1.03% |
| 过去六个月 | -10.27% | 1.84% | -3.45% | 0.73% | -6.82% | 1.11% |
| 过去一年 | 6.26% | 2.01% | -4.78% | 0.62% | 11.04% | 1.39% |
| 过去三年 | 243.39% | 1.80% | 16.71% | 0.63% | 226.68% | 1.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 110.50% | 1.61% | 30.75% | 0.63% | 79.75% | 0.98% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%＋上证国债指数收益率×50%

1、沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本的综合性指数；样本选择标准为规模大、流动性好的股票，目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。

2、上证国债指数样本涵盖了上海证券交易所所有的国债品种，交易所的国债交易市场具有参与主体丰富、竞价交易连续的特性，能反映出市场利率的瞬息变化，也使得上证国债指数能真实地标示出利率市场整体的收益风险度。因此本基金选取的基准具有较好的代表性。

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




注：1、本基金基金合同于 2015 年 10 月 27 日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的 0%-95%；每个交易日日终，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金（含股指期货合约需缴纳的交易保证金等）、应收申购款等。

## §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 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：李高峰

总经理：高宇

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：徐磊

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。2021 年 9 月 2 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]2848 号文核准，山东省国际信托股份有限公司将其持有的 45%股权转让给山东省鲁信投资控股集团有限公司。目前，公司注册资本为 2 亿元人民币，股东为山东省鲁信投资控股集团有限公司、江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司。

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 2022 年 6 月末，公司有正式员工 104 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 2022 年 6 月 30 日，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信基本面 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、泰信智选成长混合、泰信鑫利混合、泰信竞争优选混合、泰信景气驱动 12 个月持有期混合、泰信汇享利率债债券、泰信低碳经济混合发起式、泰信均衡价值混合、泰信汇利三个月定开债券、泰信医疗服务混合发起式、泰信添利 30 天持有期债券发起式、泰信鑫瑞债券发起式 、泰信汇盈债券共 30 只开放式基金及 39 个资产管理计划。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴秉韬 | 研究部总监、泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经 | 2019 年 7 月 25 日 | - | 11 年 | 吴秉韬先生，上海交通大学环境工程专业硕士。2011 年 4 月加入泰信基金管理有限公司，历任助理研究员、研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理兼研究员，现任研究部总监兼基金经理。2019 年 7 月至今任泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月至今任泰 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 理、泰信优质生活混合型证券投资基金基金经理、泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金基金经理 | | | | 信优质生活混合型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月至今任泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金基金经理。 |

注：1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

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遵规守信情况的说明

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》、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法律法规和基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输

送的同日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，亦无其他异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年一季度，3 月中国制造业 PMI 为 49.5%，回落 0.7 个百分点，降至荣枯线下。景气逆季节性回落，由扩张转为收缩。主要分项中，需求回落，生产续降，库存分化，价格续升，新订单指数显著转弱是制造业 PMI 回落的主因。分项目看，3 月新订单指数、新出口订单指数分别回落至 48.8%、47.2%，双双降至荣枯线下。价格方面，3 月主要原材料购进价格指数、出厂价格指数分别续升至 66.1%、56.7%，二者之差扩大至 9.4%，反映企业原材料成本压力进一步升高。非制造业方面，3 月非制造业商务活动指数回落至 48.4%，重回荣枯线下。因为疫情原因，服务业商务活动指数回落 3.8 个百分点至 46.7%。总结来看，3 月受到俄乌冲突带动大宗上涨，以及国内疫情持续冲击供需，带来供需逆季节性转弱，双双降至荣枯线以下，企业盈利能力受到挤压。流动性方面，2021 年 12 月四季度货币政策例会上，央行延续了中央经济工作会议提出的“稳字当头、稳中求进”的会议精神，要求“加大跨周期调节力度，与逆周期调节相结合”；并首次提出“发挥好货币政策工具的总量和结构双重功能，更加主动有为，加大对实体经济的支持力度”。2022 年 1 月 17 日，央行分别下调 MLF 和公开市场逆回购操作的中标利率 10 个基点。1 月 20 日央行宣布 5 年起 LPR 下调 5bp 到 4.6%。考虑到近期的疫情对于国内经济的扰动，以及海外发达经济体政策的加速收敛将导致外部环境更为复杂，俄乌冲突带来的大宗商品的持续上涨，我们认为国内的货币环境将总体维持宽松，本基金一季度仍然主要以电力设备新能源板块为主，适当增加了地产等稳增长板块配置。

二季度，经济基本面方面，6 月制造业 PMI 续升 0.6 个百分点至 50.2%，重回荣枯线上，但整体低于历年均值 0.4pct。主要分项中，新订单、生产指数双双反弹至荣枯线上。分项目看， 6 月新订单指数继续回升至 50.4%，但略低于历年同期均值，新出口订单指数继续回升至 49.5%，高于历年同期均值。整体来看，需求环比确有恢复但整体不强。价格方面，原材料、出厂价格指数分别续降至 52%、46.3%。出厂价格与主要原材料购进价格之差进一步下探至-5.7%。这反映出，企业原材料成本压力虽然边际减少,但去库压力同样较大，企业盈利难言乐观。6 月非制造业商务活动指数续升 6.9 个百分点至 54.7%，服务业商务活动指数续升至 54.3%，重回荣枯线上。尤其值得注意的是，前期较为低迷的交运、住宿、餐饮、批发等行业景气均重回荣枯线上。总体上看，6 月制造业、建筑业、服务业景气均处于扩张区间，经济修复正在演绎，生产快于需求转好。流动方面，4 月 29 日召开中央政治局会议，基本与之前召开的国常会、金融委、财经委等多个会议的

基调保持一致，强调稳经济的重要性，宏观政策要稳健有效，加大财政政策和货币政策的实施力度。在宏观政策方面，直接表示“要加大宏观政策调节力度，扎实稳住经济”，明确了政策边际宽松的基调。此前， 4 月 15 日央行宣布全面降准释放长期资金约 5300 亿元，并下调金融机构外汇存款准备金率 1 个百分点，意在稳资金、稳汇率。6 月社融新增 5.17 万亿，比上年同期多增 1.47 万亿元，社融存量增速 10.8%，进一步上行。我们认为目前经济仍在复苏，资产价格泡沫并不明显，房地产销售压力仍存，央行主动收紧流动性概率较低。本基金观察到新能源方向基本面持续超预期，故增加了电力设备新能源板块配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.105 元；本报告期基金份额净值增长率为-10.27%，业绩比较基准收益率为-3.45%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对当前宏观环境的判断： 6 月制造业 PMI 续升 0.6 个百分点至 50.2%，重回荣枯线上，但整体低于历年均值 0.4pct。主要分项中，新订单、生产指数双双反弹至荣枯线上。分项目看， 6 月新订单指数继续回升至 50.4%，但略低于历年同期均值，新出口订单指数继续回升至 49.5%，高于历年同期均值。整体来看，需求环比确有恢复但整体不强。出厂价格与主要原材料购进价格之差进一步下探至-5.7%。这反映出，企业原材料成本压力虽然边际减少,但去库压力同样较大，企业盈利难言乐观。6 月非制造业商务活动指数续升 6.9 个百分点至 54.7%，服务业商务活动指数续升至 54.3%，重回荣枯线上。总体上看，6 月制造业、建筑业、服务业景气均处于扩张区间，经济修复正在演绎，生产快于需求转好。

流动方面，4 月 29 日召开中央政治局会议，基本与之前召开的国常会、金融委、财经委等多个会议的基调保持一致，强调稳经济的重要性，宏观政策要稳健有效，加大财政政策和货币政策的实施力度。4 月 15 日央行宣布全面降准释放长期资金约 5300 亿元，并下调金融机构外汇存款准备金率 1 个百分点。7 月底政治局会议提出当下“面临一些突出矛盾和问题”，强调保持战略定力、坚持稳中求进总基调，巩固经济的向好趋势，继续稳就业稳物价稳经济。我们认为目前经济复苏力度仍然较弱，房地产销售压力仍存，但又要保持战略定力，在目前宽裕的流动性环境下，进一步宽松的概率降低。

总结来看，从 6 月经济数据看，以及用电量数据看，目前经济环比修复仍在继续，虽然地产的销售波动，以及新开工、投资等的继续回落，我们认为下半年处于相比 2020 年疫情后的偏弱的复苏态势中。此种经济基本面，我们认为下半年整体货币环境，大概率从宽货币宽信用，随着经济的缓慢修复，逐步转向稳货币宽信用的转变，不具备大幅调整的基础。经济逐步复苏，流动性

相对宽松，增量资金有限，市场将呈现存量博弈，结构性特征明显。

目前时点，我们看好以下行业：

1，关注景气度持续较为确定的科技板块，重点关注新能源汽车，新能源链，军工等板块。

2， 受益于疫情修复的消费，医药等板块

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，保证基金估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本公司建立估值委员会，负责本公司基金估值业务的决策和评价、与基金估值业务相关的信息披露规定等工作。

本公司管理的基金日常估值由公司清算会计部负责。清算会计部完成估值后，将估值结果以合同约定的形式发送基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后，由管理人按约定对外公布；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。本公司在采用估值政策和程序时，应当充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过建立估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者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；

3、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。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

# §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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——泰信基金管理有限公司在本基金的投资运作、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 24,792,952.06 | 23,327,890.48 |
| 结算备付金 | | 1,333,946.83 | 7,374,659.91 |
| 存出保证金 | | 275,496.75 | 222,025.72 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 188,098,348.54 | 235,687,044.09 |
| 其中：股票投资 | | 188,098,348.54 | 235,687,044.09 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | 7,622,929.81 | 1,923,381.43 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 585,814.26 | 925,080.96 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | 4,394.21 |
| 资产总计 | | 222,709,488.25 | 269,464,476.80 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2022 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2021 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | 1,605,812.56 |
| 应付赎回款 | | 1,051,740.97 | 588,164.50 |
| 应付管理人报酬 | | 269,675.51 | 350,022.19 |
| 应付托管费 | | 44,945.94 | 58,337.01 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 1,086,042.18 | 1,451,574.05 |
| 负债合计 | | 2,452,404.60 | 4,053,910.31 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 104,643,001.12 | 113,139,092.26 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 115,614,082.53 | 152,271,474.23 |
| 净资产合计 | | 220,257,083.65 | 265,410,566.49 |
| 负债和净资产总计 | | 222,709,488.25 | 269,464,476.80 |

注： 1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金份额净值人民币 2.105 元，基金份额总额 104,643,001.12 份；

2、以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本

期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | -28,834,251.36 | 26,376,935.65 |
| 1.利息收入 | | 81,616.02 | 55,434.29 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 81,616.02 | 55,434.29 |
| 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） | | -52,377,921.53 | 20,503,405.17 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -53,462,137.45 | 20,261,120.13 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 1,084,215.92 | 242,285.04 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 23,288,296.33 | 5,512,809.25 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 173,757.82 | 305,286.94 |
| **减：二、营业总支出** | | 2,018,070.62 | 4,634,699.68 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,650,553.10 | 836,268.83 |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 275,092.23 | 139,378.18 |
| 3．销售服务费 | | - | - |
| 4．投资顾问费 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 5．利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6．信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7．税金及附加 | | - | - |
| 8．其他费用 | 6.4.7.19 | 92,425.29 | 3,659,052.67 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | -30,852,321.98 | 21,742,235.97 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | -30,852,321.98 | 21,742,235.97 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | -30,852,321.98 | 21,742,235.97 |

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 113,139,092.26 | - | 152,271,474.23 | 265,410,566.49 |
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 113,139,092.26 | - | 152,271,474.23 | 265,410,566.49 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -8,496,091.14 | - | -36,657,391.70 | -45,153,482.84 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -30,852,321.98 | -30,852,321.98 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -8,496,091.14 | - | -5,805,069.72 | -14,301,160.86 |
| 其中:1.基金申购款 | 28,203,253.50 | - | 28,946,835.01 | 57,150,088.51 |
| 2.基金赎回款 | -36,699,344.64 | - | -34,751,904.73 | -71,451,249.37 |
| （三）、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) | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基 | 104,643,001.12 | - | 115,614,082.53 | 220,257,083.65 |

| 金净值） | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 项目 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 61,094,453.52 | - | 35,159,265.74 | 96,253,719.26 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 61,094,453.52 | - | 35,159,265.74 | 96,253,719.26 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 4,285,949.55 | - | 28,968,580.01 | 33,254,529.56 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 21,742,235.97 | 21,742,235.97 |
| （二）、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） | 4,285,949.55 | - | 7,226,344.04 | 11,512,293.59 |
| 其中：1.基金申购款 | 66,361,607.48 | - | 44,270,851.52 | 110,632,459.00 |
| 2.基金赎 | -62,075,657.93 | - | -37,044,507.48 | -99,120,165.41 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 回款 | | | | |
| （三）、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） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 65,380,403.07 | - | 64,127,845.75 | 129,508,248.82 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|---|---|---|
| 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 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金（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[2015]第 1290 号《关于准予泰信国策驱动灵活配置混合型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《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型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 632,552,556.09 元业经普华永道中天会计师事务所特殊普通合伙普华永道中天验字(2015)第 1195 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 10 月 27 日正式生效基金合同生效日的基金份额总额为 632,964,112.52 份基金份额，其中认购资金利息折

合 411,556.43 份基金份额。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具(包括国内依法发行上市的股票包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含可转债、中小企业私募债券)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货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(但须符合中国证监会相关规定)。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并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的 0-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后保持现金或到期日在一年期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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部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。

### 6.4.3 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下简称“新金融工具准则”)相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号)，

公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用新金融工具准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息，金额分别为人民币 23,327,890.48 元、人民币 7,374,659.91 元、人民币 222,025.72 元、人民币 4,394.21 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息的金额分别为人民币 23,330,990.95 元、人民币 7,375,853.75 元、人民币 222,125.62 元、人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 235,687,044.09 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 0.00 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 235,687,044.09 元。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2)对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 24,792,952.06 |
| 等于：本金 | 24,789,745.75 |
| 加：应计利息 | 3,206.31 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |

| | |
|---|---|
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 24,792,952.06 |

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 156,809,087.28 | - | 188,098,348.54 | 31,289,261.26 |
| 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 | | 156,809,087.28 | - | 188,098,348.54 | 31,289,261.26 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 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。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,516.55 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 1,001,611.34 |
| 其中：交易所市场 | 1,001,611.34 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 82,914.29 |
| 合计 | 1,086,042.18 |

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 113,139,092.26 | 113,139,092.26 |
| 本期申购 | 28,203,253.50 | 28,203,253.50 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -36,699,344.64 | -36,699,344.64 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 104,643,001.12 | 104,643,001.12 |

注：申购含红利再投、转换入及份额级别调增数，赎回含转换出及份额级别调减数。

## 6.4.7.8 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 |
|---|---|---|---|
| 本期期初 | 133,620,180.77 | 18,651,293.46 | 152,271,474.23 |
| 本期利润 | -54,140,618.31 | 23,288,296.33 | -30,852,321.98 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,720,901.61 | -2,084,168.11 | -5,805,069.72 |
| 其中：基金申购款 | 26,286,660.59 | 2,660,174.42 | 28,946,835.01 |
| 基金赎回款 | -30,007,562.20 | -4,744,342.53 | -34,751,904.73 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 75,758,660.85 | 39,855,421.68 | 115,614,082.53 |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 62,009.61 |
| 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 | 17,422.98 |
| 其他 | 2,183.43 |
| 合计 | 81,616.02 |

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -53,462,137.45 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |

| | |
|---|---|
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | -53,462,137.45 |

### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 1,280,504,455.91 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,330,290,976.47 |
| 减：交易费用 | 3,675,616.89 |
| 买卖股票差价收入 | -53,462,137.45 |

### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,084,215.92 |
| 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 | 1,084,215.92 |

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 23,288,296.33 |
| 股票投资 | 23,288,296.33 |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |

| | |
|---|---|
| 2.衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 23,288,296.33 |

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 156,870.55 |
| 基金转换费收入 | 16,887.27 |
| 合计 | 173,757.82 |

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25%归入转出基金的基金资产。

## 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 23,406.92 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 511.00 |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 92,425.29 |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

## 6.4.9 关联方关系

## 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期本基金控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
| --- | --- |
| 泰信基金管理有限公司(“泰信基金管理有限公司”) | 基金管理人 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人 |
| 山东省鲁信投资控股集团有限公司 | 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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期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。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| --- | --- | --- |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,650,553.10 | 836,268.83 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 523,404.52 | 247,222.40 |

注：支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 275,092.23 | 139,378.18 |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 报告期初持有的基金份额 | 8,960,125.45 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 4,692,163.30 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 4,710,000.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 8,942,288.75 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 8.55% | - |

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。

### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 中国工商银行 | 24,792,952.06 | 62,009.61 | 18,741,227.45 | 35,784.31 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.7 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。

### 6.4.10.8 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。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配的情况。

### 6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本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。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

### 6.4.13 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。

### 6.4.13.1 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、董事会及下设审计、合规与风险控制委员会、督察长、监察稽核部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

### 6.4.13.2 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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（于 2021 年 12 月 31 日:同）。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 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 6.4.12 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

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 2022 年 6 月 30 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 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为人民币 220,046,264.11 元，超过经确认的当日净赎回金额。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

### 6.4.13.4 市场风险

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

### 6.4.13.4.1 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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |

| 资产 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 银行存款 | 24,792,952.06 | - | - | - | 24,792,952.06 |
| 结算备付金 | 1,333,946.83 | - | - | - | 1,333,946.83 |
| 存出保证金 | 275,496.75 | - | - | - | 275,496.75 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 188,098,348.54 | 188,098,348.54 |
| 应收申购款 | - | - | - | 585,814.26 | 585,814.26 |
| 应收清算款 | - | - | - | 7,622,929.81 | 7,622,929.81 |
| 资产总计 | 26,402,395.64 | - | - | 196,307,092.61 | 222,709,488.25 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,051,740.97 | 1,051,740.97 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 269,675.51 | 269,675.51 |
| 应付托管费 | - | - | - | 44,945.94 | 44,945.94 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,086,042.18 | 1,086,042.18 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,452,404.60 | 2,452,404.60 |
| 利率敏感度缺口 | 26,402,395.64 | - | - | 193,854,688.01 | 220,257,083.65 |
| 上年度末<br>2021 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 | 23,327,890.48 | - | - | - | 23,327,890.48 |
| 结算备付金 | 7,374,659.91 | - | - | - | 7,374,659.91 |
| 存出保证金 | 222,025.72 | - | - | - | 222,025.72 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 235,687,044.09 | 235,687,044.09 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,923,381.43 | 1,923,381.43 |
| 应收利息 | - | - | - | 4,394.21 | 4,394.21 |
| 应收申购款 | - | - | - | 925,080.96 | 925,080.96 |
| 资产总计 | 30,924,576.11 | - | - | 238,539,900.69 | 269,464,476.80 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,605,812.56 | 1,605,812.56 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 588,164.50 | 588,164.50 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 350,022.19 | 350,022.19 |
| 应付托管费 | - | - | - | 58,337.01 | 58,337.01 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,322,766.65 | 1,322,766.65 |
| 其他负债 | - | - | - | 128,807.40 | 128,807.40 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,053,910.31 | 4,053,910.31 |
| 利率敏感度缺口 | 30,924,576.11 | - | - | 234,485,990.38 | 265,410,566.49 |

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。

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2021 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

### 6.4.13.4.2 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。

### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2021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 | 188,098,348.54 | 85.40 | 235,687,044.09 | 88.80 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 188,098,348.54 | 85.40 | 235,687,044.09 | 88.80 |

### 6.4.13.4.2.2 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 （2022 年 6 月 30 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日 ） |
| | 1.业绩比较基准上升 5% | 22,494,855.95 | 23,580,468.42 |
| | 2.业绩比较基准下降 5% | -22,494,855.95 | -23,580,468.42 |

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

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 188,098,348.54 | 235,381,357.49 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | 305,686.60 |
| 合计 | 188,098,348.54 | 235,687,044.09 |

#### 6.4.14.2.2 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可转换债券，若出现重大事项停牌、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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相同。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 188,098,348.54 | 84.46 |
| | 其中：股票 | 188,098,348.54 | 84.46 |
| 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 | 26,126,898.89 | 11.73 |
| 8 | 其他各项资产 | 8,484,240.82 | 3.81 |
| 9 | 合计 | 222,709,488.25 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 12,948,442.87 | 5.88 |
| C | 制造业 | 161,668,393.67 | 73.40 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 4,335,339.00 | 1.97 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,748,574.00 | 1.25 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,397,599.00 | 2.90 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 188,098,348.54 | 85.40 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 25,840 | 13,798,560.00 | 6.26 |
| 2 | 002459 | 晶澳科技 | 170,643 | 13,463,732.70 | 6.11 |
| 3 | 601012 | 隆基绿能 | 158,667 | 10,571,982.21 | 4.80 |
| 4 | 002466 | 天齐锂业 | 81,700 | 10,196,160.00 | 4.63 |
| 5 | 300953 | 震裕科技 | 69,192 | 9,478,612.08 | 4.30 |
| 6 | 603688 | 石英股份 | 66,287 | 8,790,319.07 | 3.99 |
| 7 | 002460 | 赣锋锂业 | 55,400 | 8,237,980.00 | 3.74 |
| 8 | 300438 | 鹏辉能源 | 131,695 | 8,092,657.75 | 3.67 |
| 9 | 605117 | 德业股份 | 26,638 | 7,455,709.82 | 3.39 |
| 10 | 688063 | 派能科技 | 23,223 | 7,250,220.60 | 3.29 |
| 11 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 309,965 | 7,194,287.65 | 3.27 |
| 12 | 000762 | 西藏矿业 | 127,521 | 7,132,249.53 | 3.24 |
| 13 | 002176 | 江特电机 | 281,001 | 7,036,265.04 | 3.19 |
| 14 | 600323 | 瀚蓝环境 | 312,078 | 6,397,599.00 | 2.90 |
| 15 | 600256 | 广汇能源 | 551,821 | 5,816,193.34 | 2.64 |
| 16 | 002782 | 可立克 | 309,500 | 5,273,880.00 | 2.39 |
| 17 | 688556 | 高测股份 | 65,100 | 5,253,570.00 | 2.39 |
| 18 | 002838 | 道恩股份 | 212,300 | 5,214,088.00 | 2.37 |
| 19 | 300910 | 瑞丰新材 | 72,700 | 4,596,094.00 | 2.09 |
| 20 | 002865 | 钧达股份 | 46,993 | 4,481,252.48 | 2.03 |
| 21 | 600325 | 华发股份 | 572,700 | 4,335,339.00 | 1.97 |
| 22 | 002594 | 比亚迪 | 10,600 | 3,534,994.00 | 1.60 |
| 23 | 000893 | 亚钾国际 | 95,138 | 3,273,698.58 | 1.49 |
| 24 | 603348 | 文灿股份 | 60,351 | 3,234,813.60 | 1.47 |
| 25 | 600884 | 杉杉股份 | 99,347 | 2,952,592.84 | 1.34 |
| 26 | 300073 | 当升科技 | 30,624 | 2,766,572.16 | 1.26 |
| 27 | 601888 | 中国中免 | 11,800 | 2,748,574.00 | 1.25 |
| 28 | 002240 | 盛新锂能 | 42,865 | 2,587,331.40 | 1.17 |
| 29 | 603938 | 三孚股份 | 49,215 | 2,432,697.45 | 1.10 |
| 30 | 002756 | 永兴材料 | 12,500 | 1,902,625.00 | 0.86 |
| 31 | 600519 | 贵州茅台 | 706 | 1,443,770.00 | 0.66 |
| 32 | 002738 | 中矿资源 | 9,400 | 870,534.00 | 0.40 |
| 33 | 688008 | 澜起科技 | 4,678 | 283,393.24 | 0.13 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 002466 | 天齐锂业 | 33,319,066.40 | 12.55 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 31,816,952.62 | 11.99 |
| 3 | 601012 | 隆基绿能 | 29,693,788.74 | 11.19 |
| 4 | 000961 | 中南建设 | 23,152,849.00 | 8.72 |
| 5 | 600048 | 保利发展 | 20,400,640.00 | 7.69 |
| 6 | 001979 | 招商蛇口 | 19,732,461.65 | 7.43 |
| 7 | 002897 | 意华股份 | 19,476,802.00 | 7.34 |
| 8 | 600325 | 华发股份 | 18,355,890.62 | 6.92 |
| 9 | 002459 | 晶澳科技 | 17,853,176.00 | 6.73 |
| 10 | 000893 | 亚钾国际 | 17,644,948.00 | 6.65 |
| 11 | 000069 | 华侨城 A | 17,278,461.00 | 6.51 |
| 12 | 688267 | 中触媒 | 17,194,425.68 | 6.48 |
| 13 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 17,139,541.93 | 6.46 |
| 14 | 603806 | 福斯特 | 16,472,856.00 | 6.21 |
| 15 | 688559 | 海目星 | 16,276,504.95 | 6.13 |
| 16 | 300390 | 天华超净 | 16,230,181.00 | 6.12 |
| 17 | 000739 | 普洛药业 | 15,679,645.55 | 5.91 |
| 18 | 600256 | 广汇能源 | 14,642,689.28 | 5.52 |
| 19 | 002709 | 天赐材料 | 14,498,219.64 | 5.46 |
| 20 | 300953 | 震裕科技 | 14,436,461.00 | 5.44 |
| 21 | 002240 | 盛新锂能 | 13,912,755.00 | 5.24 |
| 22 | 688008 | 澜起科技 | 13,688,873.14 | 5.16 |
| 23 | 002432 | 九安医疗 | 13,650,763.00 | 5.14 |
| 24 | 000009 | 中国宝安 | 13,383,874.07 | 5.04 |
| 25 | 600323 | 瀚蓝环境 | 13,122,008.80 | 4.94 |
| 26 | 603688 | 石英股份 | 11,812,308.00 | 4.45 |
| 27 | 601865 | 福莱特 | 11,683,547.45 | 4.40 |
| 28 | 300496 | 中科创达 | 11,631,314.00 | 4.38 |
| 29 | 600380 | 健康元 | 11,583,218.76 | 4.36 |
| 30 | 300438 | 鹏辉能源 | 11,465,314.00 | 4.32 |
| 31 | 300118 | 东方日升 | 11,109,929.00 | 4.19 |
| 32 | 300751 | 迈为股份 | 10,840,690.48 | 4.08 |
| 33 | 002518 | 科士达 | 10,837,619.08 | 4.08 |
| 34 | 688071 | 华依科技 | 10,781,575.88 | 4.06 |
| 35 | 002176 | 江特电机 | 10,125,237.46 | 3.81 |
| 36 | 002966 | 苏州银行 | 9,934,556.00 | 3.74 |
| 37 | 603098 | 森特股份 | 9,795,481.00 | 3.69 |
| 38 | 300073 | 当升科技 | 9,784,720.00 | 3.69 |
| 39 | 002487 | 大金重工 | 9,761,897.00 | 3.68 |
| 40 | 605117 | 德业股份 | 9,591,789.00 | 3.61 |
| 41 | 000762 | 西藏矿业 | 9,477,235.00 | 3.57 |
| 42 | 600011 | 华能国际 | 9,113,930.00 | 3.43 |
| 43 | 688687 | 凯因科技 | 9,038,284.67 | 3.41 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 44 | 000975 | 银泰黄金 | 8,958,128.00 | 3.38 |
| 45 | 603987 | 康德莱 | 8,881,169.00 | 3.35 |
| 46 | 000333 | 美的集团 | 8,785,192.07 | 3.31 |
| 47 | 000002 | 万　　科 A | 8,780,122.00 | 3.31 |
| 48 | 002074 | 国轩高科 | 8,706,290.00 | 3.28 |
| 49 | 000848 | 承德露露 | 8,693,858.14 | 3.28 |
| 50 | 300035 | 中科电气 | 8,636,574.00 | 3.25 |
| 51 | 000537 | 广宇发展 | 8,597,483.54 | 3.24 |
| 52 | 300274 | 阳光电源 | 8,481,271.00 | 3.20 |
| 53 | 603456 | 九洲药业 | 8,248,879.00 | 3.11 |
| 54 | 600988 | 赤峰黄金 | 8,103,541.00 | 3.05 |
| 55 | 601717 | 郑煤机 | 7,837,865.00 | 2.95 |
| 56 | 002460 | 赣锋锂业 | 7,837,564.00 | 2.95 |
| 57 | 300026 | 红日药业 | 7,680,402.99 | 2.89 |
| 58 | 002865 | 钧达股份 | 7,535,082.00 | 2.84 |
| 59 | 600809 | 山西汾酒 | 7,533,973.20 | 2.84 |
| 60 | 600884 | 杉杉股份 | 7,401,967.79 | 2.79 |
| 61 | 600266 | 城建发展 | 7,401,937.00 | 2.79 |
| 62 | 002371 | 北方华创 | 7,313,643.93 | 2.76 |
| 63 | 600863 | 内蒙华电 | 6,932,958.00 | 2.61 |
| 64 | 002516 | 旷达科技 | 6,929,636.00 | 2.61 |
| 65 | 000001 | 平安银行 | 6,884,375.00 | 2.59 |
| 66 | 002756 | 永兴材料 | 6,813,744.00 | 2.57 |
| 67 | 002271 | 东方雨虹 | 6,645,875.00 | 2.50 |
| 68 | 600703 | 三安光电 | 6,631,514.00 | 2.50 |
| 69 | 600383 | 金地集团 | 6,461,871.00 | 2.43 |
| 70 | 002555 | 三七互娱 | 6,416,041.00 | 2.42 |
| 71 | 003031 | 中瓷电子 | 6,375,903.55 | 2.40 |
| 72 | 601668 | 中国建筑 | 6,358,347.00 | 2.40 |
| 73 | 600519 | 贵州茅台 | 6,342,611.00 | 2.39 |
| 74 | 688223 | 晶科能源 | 6,193,696.02 | 2.33 |
| 75 | 600376 | 首开股份 | 6,187,748.00 | 2.33 |
| 76 | 002812 | 恩捷股份 | 6,131,201.00 | 2.31 |
| 77 | 688599 | 天合光能 | 6,121,148.17 | 2.31 |
| 78 | 688155 | 先惠技术 | 6,077,347.05 | 2.29 |
| 79 | 600010 | 包钢股份 | 5,910,326.00 | 2.23 |
| 80 | 000792 | 盐湖股份 | 5,895,732.00 | 2.22 |
| 81 | 688180 | 君实生物 | 5,713,072.13 | 2.15 |
| 82 | 600745 | 闻泰科技 | 5,701,565.00 | 2.15 |
| 83 | 600782 | 新钢股份 | 5,658,757.00 | 2.13 |
| 84 | 601390 | 中国中铁 | 5,392,417.00 | 2.03 |
| 85 | 002838 | 道恩股份 | 5,377,679.00 | 2.03 |

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 30,050,911.44 | 11.32 |
| 2 | 002466 | 天齐锂业 | 29,392,576.66 | 11.07 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 28,239,202.94 | 10.64 |
| 4 | 000537 | 广宇发展 | 23,823,511.32 | 8.98 |
| 5 | 000961 | 中南建设 | 22,398,306.05 | 8.44 |
| 6 | 601012 | 隆基绿能 | 21,272,298.22 | 8.01 |
| 7 | 002897 | 意华股份 | 19,856,359.53 | 7.48 |
| 8 | 600048 | 保利发展 | 19,391,304.07 | 7.31 |
| 9 | 300035 | 中科电气 | 18,461,926.01 | 6.96 |
| 10 | 600809 | 山西汾酒 | 18,279,311.81 | 6.89 |
| 11 | 688559 | 海目星 | 18,275,990.94 | 6.89 |
| 12 | 001979 | 招商蛇口 | 17,975,050.33 | 6.77 |
| 13 | 603806 | 福斯特 | 17,715,757.20 | 6.67 |
| 14 | 600519 | 贵州茅台 | 17,544,782.04 | 6.61 |
| 15 | 002240 | 盛新锂能 | 17,215,921.66 | 6.49 |
| 16 | 002475 | 立讯精密 | 16,012,923.02 | 6.03 |
| 17 | 002812 | 恩捷股份 | 15,566,741.77 | 5.87 |
| 18 | 300073 | 当升科技 | 15,479,803.75 | 5.83 |
| 19 | 688267 | 中触媒 | 14,834,894.43 | 5.59 |
| 20 | 000069 | 华侨城 A | 14,832,568.66 | 5.59 |
| 21 | 002709 | 天赐材料 | 14,559,833.76 | 5.49 |
| 22 | 300390 | 天华超净 | 14,516,820.45 | 5.47 |
| 23 | 000739 | 普洛药业 | 14,248,418.29 | 5.37 |
| 24 | 000893 | 亚钾国际 | 13,912,478.49 | 5.24 |
| 25 | 600325 | 华发股份 | 13,714,657.13 | 5.17 |
| 26 | 600499 | 科达制造 | 13,650,355.15 | 5.14 |
| 27 | 300568 | 星源材质 | 13,407,384.08 | 5.05 |
| 28 | 000009 | 中国宝安 | 13,377,158.15 | 5.04 |
| 29 | 002432 | 九安医疗 | 13,015,067.65 | 4.90 |
| 30 | 603098 | 森特股份 | 12,304,817.58 | 4.64 |
| 31 | 300751 | 迈为股份 | 11,980,404.91 | 4.51 |
| 32 | 688008 | 澜起科技 | 11,906,280.97 | 4.49 |
| 33 | 300118 | 东方日升 | 11,321,391.04 | 4.27 |
| 34 | 600380 | 健康元 | 11,153,126.73 | 4.20 |
| 35 | 300496 | 中科创达 | 11,026,332.45 | 4.15 |
| 36 | 002518 | 科士达 | 10,864,449.71 | 4.09 |
| 37 | 601865 | 福莱特 | 10,842,754.27 | 4.09 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 38 | 002074 | 国轩高科 | 10,779,572.01 | 4.06 |
| 39 | 600011 | 华能国际 | 10,658,831.14 | 4.02 |
| 40 | 688116 | 天奈科技 | 10,486,604.13 | 3.95 |
| 41 | 603688 | 石英股份 | 10,156,961.40 | 3.83 |
| 42 | 002487 | 大金重工 | 9,659,996.43 | 3.64 |
| 43 | 600256 | 广汇能源 | 9,649,494.41 | 3.64 |
| 44 | 002966 | 苏州银行 | 9,261,487.32 | 3.49 |
| 45 | 688071 | 华依科技 | 8,899,636.44 | 3.35 |
| 46 | 300763 | 锦浪科技 | 8,864,641.89 | 3.34 |
| 47 | 002459 | 晶澳科技 | 8,835,451.98 | 3.33 |
| 48 | 000002 | 万　　科 A | 8,567,698.89 | 3.23 |
| 49 | 000333 | 美的集团 | 8,460,798.11 | 3.19 |
| 50 | 000792 | 盐湖股份 | 8,312,477.59 | 3.13 |
| 51 | 605117 | 德业股份 | 8,307,239.88 | 3.13 |
| 52 | 600323 | 瀚蓝环境 | 8,283,032.30 | 3.12 |
| 53 | 300393 | 中来股份 | 8,225,967.49 | 3.10 |
| 54 | 300274 | 阳光电源 | 8,184,085.87 | 3.08 |
| 55 | 000975 | 银泰黄金 | 8,049,281.00 | 3.03 |
| 56 | 000848 | 承德露露 | 7,878,672.22 | 2.97 |
| 57 | 300026 | 红日药业 | 7,870,666.68 | 2.97 |
| 58 | 603987 | 康德莱 | 7,624,959.79 | 2.87 |
| 59 | 688687 | 凯因科技 | 7,528,104.86 | 2.84 |
| 60 | 601717 | 郑煤机 | 7,487,099.97 | 2.82 |
| 61 | 603456 | 九洲药业 | 7,237,485.30 | 2.73 |
| 62 | 002139 | 拓邦股份 | 7,118,911.39 | 2.68 |
| 63 | 600988 | 赤峰黄金 | 7,071,289.08 | 2.66 |
| 64 | 002371 | 北方华创 | 6,852,860.69 | 2.58 |
| 65 | 600703 | 三安光电 | 6,840,185.86 | 2.58 |
| 66 | 600863 | 内蒙华电 | 6,724,085.00 | 2.53 |
| 67 | 000001 | 平安银行 | 6,656,934.99 | 2.51 |
| 68 | 002555 | 三七互娱 | 6,595,284.73 | 2.48 |
| 69 | 600266 | 城建发展 | 6,576,233.14 | 2.48 |
| 70 | 600702 | 舍得酒业 | 6,514,837.42 | 2.45 |
| 71 | 688223 | 晶科能源 | 6,514,049.24 | 2.45 |
| 72 | 002271 | 东方雨虹 | 6,372,349.43 | 2.40 |
| 73 | 601668 | 中国建筑 | 6,336,579.50 | 2.39 |
| 74 | 300014 | 亿纬锂能 | 6,320,949.63 | 2.38 |
| 75 | 688155 | 先惠技术 | 6,205,278.58 | 2.34 |
| 76 | 600010 | 包钢股份 | 6,161,315.86 | 2.32 |
| 77 | 003031 | 中瓷电子 | 6,109,927.96 | 2.30 |
| 78 | 600383 | 金地集团 | 5,883,898.41 | 2.22 |
| 79 | 002516 | 旷达科技 | 5,831,178.55 | 2.20 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 80 | 688599 | 天合光能 | 5,772,517.98 | 2.17 |
| 81 | 688390 | 固德威 | 5,725,368.68 | 2.16 |
| 82 | 600745 | 闻泰科技 | 5,572,836.78 | 2.10 |
| 83 | 601390 | 中国中铁 | 5,497,230.00 | 2.07 |
| 84 | 300438 | 鹏辉能源 | 5,410,625.88 | 2.04 |
| 85 | 600376 | 首开股份 | 5,340,749.00 | 2.01 |
| 86 | 600782 | 新钢股份 | 5,332,980.99 | 2.01 |

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,259,413,984.59 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,280,504,455.91 |

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

## 7.5 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。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

报告期末本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

报告期末本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本期末投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 275,496.75 |
| 2 | 应收清算款 | 7,622,929.81 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 585,814.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,484,240.82 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

# §8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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（%） |
| 9,912 | 10,557.20 | 27,029,332.13 | 25.83 | 77,613,668.99 | 74.17 |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 492,650.20 | 0.4708 |

### 8.3 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 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

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 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2015 年 10 月 27 日）基金份额总额 | 632,964,112.52 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 113,139,092.26 |
| 本报告期基金总申购份额 | 28,203,253.50 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 36,699,344.64 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 104,643,001.12 |

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过,自 2022 年 4 月 26 日起，总经理高宇先生代任公司董事长职务，万众先生不再任公司董事长职务。具体详情参见 2022 年 4 月 28 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 2022 年 6 月 30 日起，李高峰先生担任公司董事长职务，总经理高宇先生不再代任公司董事长职务。具体详情参见 2022 年 7 月 1 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董事长变更的公告》。本公司上述人事变动已按相关规定进行备案。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| 民生证券 | 1 | 449,965,676.86 | 17.72 | 419,052.26 | 19.25 | - |
| 广发证券 | 2 | 397,828,035.95 | 15.66 | 365,313.57 | 16.78 | - |
| 恒泰证券 | 1 | 292,141,028.67 | 11.50 | 213,642.48 | 9.81 | - |
| 中泰证券 | 1 | 240,559,653.29 | 9.47 | 224,032.23 | 10.29 | - |
| 国盛证券 | 1 | 225,561,827.11 | 8.88 | 164,953.65 | 7.58 | - |
| 银河证券 | 1 | 224,326,226.57 | 8.83 | 206,320.64 | 9.48 | - |
| 浙商证券 | 1 | 193,905,077.03 | 7.63 | 176,706.19 | 8.12 | - |
| 华福证券 | 1 | 137,828,152.89 | 5.43 | 100,793.30 | 4.63 | - |
| 国信证券 | 2 | 105,504,127.39 | 4.15 | 97,201.26 | 4.46 | - |
| 东北证券 | 1 | 81,715,417.06 | 3.22 | 58,941.39 | 2.71 | - |
| 国融证券 | 1 | 74,818,148.87 | 2.95 | 54,714.10 | 2.51 | - |
| 东兴证券 | 1 | 54,878,852.19 | 2.16 | 51,107.82 | 2.35 | - |
| 山西证券 | 1 | 43,843,331.79 | 1.73 | 32,062.59 | 1.47 | - |
| 德邦证券 | 1 | 17,042,884.83 | 0.67 | 12,463.37 | 0.57 | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西藏东财 | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 野村东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | 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： 天风证券深圳 001905、野村东方国际证券上海 54798；退租交易单元：无。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国融证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西藏东财 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - |
| 野村东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 关于旗下部分基金北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 1 月 7 日 |
| 2 | 关于旗下部分基金新增奕丰基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 1 月 11 日 |
| 3 | 关于旗下部分基金在上海华夏财富投资管理有限公司开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 1 月 17 日 |
| 4 | 关于旗下部分基金新增中国民生银行股份有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 1 月 19 日 |
| 5 | 2021 年第 4 季度报告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 1 月 24 日 |
| 6 | 关于旗下部分基金新增海银基金销售有 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 1 月 26 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告 | | |
| 7 | 泰信国策驱动混合基金更新招募说明书（2022 年 1 号）、产品资料概要更新 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 3 月 11 日 |
| 8 | 关于旗下部分开放式基金参加国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告 | 《证券日报》、规定网站 | 2022 年 3 月 14 日 |
| 9 | 关于旗下部分开放式基金在北京创金启富基金销售有限公司参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 3 月 24 日 |
| 10 | 2021 年年度报告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 3 月 29 日 |
| 11 | 2022 年第 1 季度报告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 4 月 21 日 |
| 12 | 关于旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 4 月 28 日 |
| 13 | 关于基金行业高级管理人员变更的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 4 月 28 日 |
| 14 | 关于调整旗下部分基金在申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司申购、定期定额投资、赎回、转换业务起点金额（份额）并参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 6 月 10 日 |
| 15 | 关于旗下部分开放式基金参加和讯科技费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 6 月 21 日 |
| 16 | 关于调整旗下部分基金在华宝证券股份有限公司申购起点的公告 | 《证券日报》、规定网站 | 2022 年 6 月 21 日 |
| 17 | 关于旗下部分基金新增江海证券有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2022 年 6 月 22 日 |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无影响投资者决策的其他重要信息。 |

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、报告期内本基金在规定媒介对外披露的各项公告

## 12.2 存放地点

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

## 12.3 查阅方式

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

**泰信基金管理有限公司**

**2022 年 8 月 26 日**