

泰信均衡价值混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 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 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| § 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 | 39 |
| 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 | 39 |
| 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 | 39 |
| 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 | 39 |

| | |
|--|-----------|
| 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 | 39 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 39 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 40 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 40 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 41 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 41 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 41 |
| 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 | 41 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 41 |
| § 10 重大事件揭示 | 42 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 42 |
| 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 | 42 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 43 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 43 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 43 |
| 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 | 43 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 43 |
| 10.8 其他重大事件 | 44 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 44 |
| 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 | 44 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 44 |
| § 12 备查文件目录 | 44 |
| 12.1 备查文件目录 | 44 |
| 12.2 存放地点 | 45 |
| 12.3 查阅方式 | 45 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|----------------|
| 基金名称 | 泰信均衡价值混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 泰信均衡价值混合 | |
| 基金主代码 | 013757 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 12 月 22 日 | |
| 基金管理人 | 泰信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 65,737,524.44 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 泰信均衡价值混合 A | 泰信均衡价值混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013757 | 013758 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 58,411,212.61 份 | 7,326,311.83 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在保持良好流动性的基础上，优化资产的均衡配置，精选具有价值优势的投资标的，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过研究和把握经济周期的内在规律，判断市场风格，优化各类资产的均衡配置，以期在控制投资组合风险的前提下，实现本基金长期、稳健的投资收益。具体包括：1、通过对宏观经济运行状况、货币金融运行状况、证券市场运行状况及政策动态等因素“自上而下”的分析，同时对市场风格进行判断，并且评估各类资产的投资价值，研究各类资产价值的变化趋势，均衡合理地进行股票、债券等各大类资产的配置；2、股票投资策略：在风格配置上注重均衡，将根据对市场风格和估值水平的判断和评估，精选匹配市场风格、具备核心竞争力且估值合理的优质个股；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、资产支持证券投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘小舫 |
| | 联系电话 | 021-20899003 |
| | 电子邮箱 | xxpl@ftfund.com |
| | | 任航 |
| | | 010-66060069 |
| | | tgxxpl@abchina.com |

| | | |
|--------|---------------------------------|------------------------------|
| 客户服务电话 | 400-888-5988 | 95599 |
| 传真 | 021-20899008 | 010-68121816 |
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层 | 北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | 200120 | 100031 |
| 法定代表人 | 李高峰 | 谷澍 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 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(2024年1月1日-2024年6月30日) | |
|-------------------|---------------------------|-------------|
| | 泰信均衡价值混合 A | 泰信均衡价值混合 C |
| 本期已实现收益 | -4,672,416.49 | -590,465.96 |
| 本期利润 | -3,723,157.62 | -514,789.88 |
| 加权平均基金份额 本期利润 | -0.0621 | -0.0679 |
| 本期加权平均净 值利润率 | -9.97% | -11.03% |
| 本期基金份额净 值增长率 | -9.19% | -9.41% |
| 3.1.2 期末数 据和指标 | 报告期末(2024年6月30日) | |

| | | |
|--------------|------------------|---------------|
| 期末可供分配利润 | -23,369,147.99 | -2,987,874.00 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.4001 | -0.4078 |
| 期末基金资产净值 | 35,042,064.62 | 4,338,437.83 |
| 期末基金份额净值 | 0.5999 | 0.5922 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -40.01% | -40.78% |

注：1、本基金合同于 2021 年 12 月 22 日正式生效。

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

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

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰信均衡价值混合 A

| 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 | -5.45% | 0.76% | -1.60% | 0.28% | -3.85% | 0.48% |
| 过去三个月 | -5.56% | 1.10% | -0.49% | 0.44% | -5.07% | 0.66% |
| 过去六个月 | -9.19% | 1.25% | 2.37% | 0.53% | -11.56% | 0.72% |
| 过去一年 | -22.82% | 1.01% | -3.42% | 0.52% | -19.40% | 0.49% |
| 自基金合同生效起至今 | -40.01% | 1.17% | -13.85% | 0.62% | -26.16% | 0.55% |

泰信均衡价值混合 C

| 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 | -5.49% | 0.76% | -1.60% | 0.28% | -3.89% | 0.48% |

| | | | | | | |
|----------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三个月 | -5.67% | 1.10% | -0.49% | 0.44% | -5.18% | 0.66% |
| 过去六个月 | -9.41% | 1.25% | 2.37% | 0.53% | -11.78% | 0.72% |
| 过去一年 | -23.20% | 1.01% | -3.42% | 0.52% | -19.78% | 0.49% |
| 自基金合同生效 起至今 | -40.78% | 1.17% | -13.85% | 0.62% | -26.93% | 0.55% |

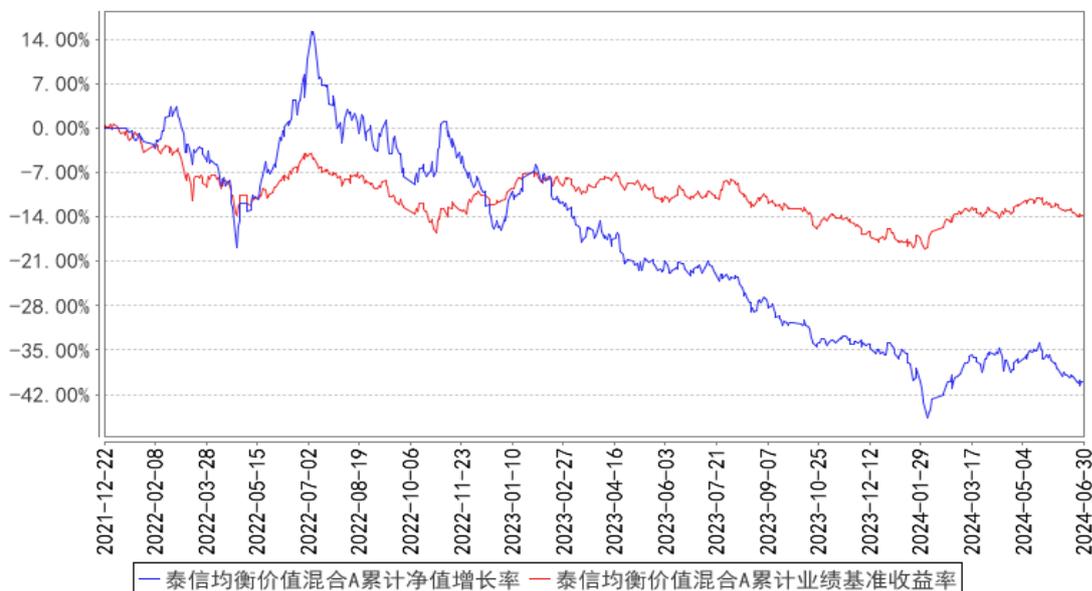
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。本基金选择该指数收益率来衡量 A 股股票投资部分的绩效。

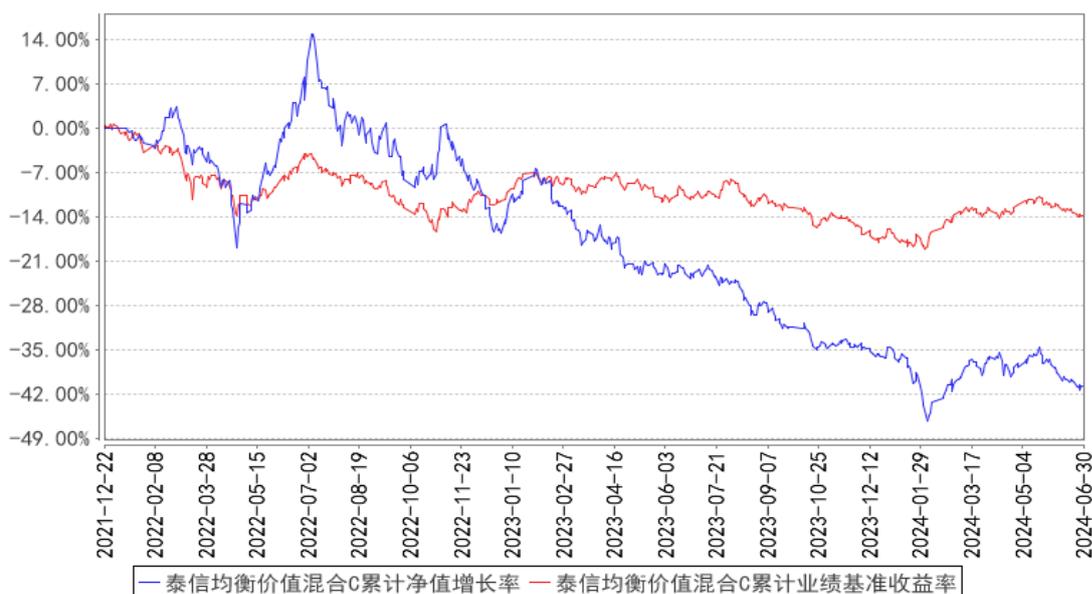
中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，指数样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成。该指数涵盖了银行间和交易所债券市场，具有广泛的市场代表性，适合作为本基金的业绩比较基准。

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

泰信均衡价值混合A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



泰信均衡价值混合C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 2021 年 12 月 22 日生效。

2、本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的 35-80%。本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

§ 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：张秉麟

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（现更名为青岛国信产融控股（集团）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。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、青岛国信产融控股（集团）有限公司。

公司目前下设办公室、党群工作部、人力资源部、纪委办公室、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、上海锐懿资产管理有限公司。截至 2024 年 6 月末，公司有正式员工 125 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 2024 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、泰信优势领航混合、泰信添鑫中短债债券、泰信汇鑫三个月定开债券、泰信添益 90 天持有期债券、泰信添安增利九个月持有期债券共 33 只开放式基金及 32 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 | | |
| 王博强 | 泰信先行策略开放式证券投资基金基金经理、泰信景气驱动 12 个月持有期混合型证 | 2021 年 12 月 22 日 | - | 16 年 | 王博强先生，英国城市大学投资管理专业硕士。2008 年 12 月加入泰信基金管理有限公司，历任基金投资部行政助理、集中交易部交易员、研究部助理研究员、研究员、高级研究员兼基金经理助理。2018 年 5 月至 2020 年 5 月任泰信竞争优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 3 月至 2022 年 8 月任泰信现代服务业混合型证券投资基金基金经理，2016 年 6 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| 券投资基金基金经理、泰信均衡价值混合型证券投资基金基金经理、泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、公司旗下资产管理计划投资经理 | | | | 月至今任泰信先行策略开放式证券投资基金基金经理，2021 年 4 月至今任泰信景气驱动 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至今任泰信均衡价值混合型证券投资基金基金经理，2024 年 5 月至今任泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月至今兼任公司旗下资产管理计划投资经理。 |
|--|--|--|--|--|

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《证券投资基金经营机构董事、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

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|-----|----------|---------|------------------|-----------------|
| 王博强 | 公募基金 | 4 | 1,330,152,070.40 | 2015 年 3 月 17 日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 166,364,267.58 | 2020 年 8 月 13 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 5 | 1,496,516,337.98 | - |

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》、《泰信均衡价值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部集中执行，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，根据投资交易监控与价差分析情况，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。

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

本报告期内，市场先扬后抑。大盘股，高分红策略表现较好，中小市值风格表现不佳。

我们年初采取了市值哑铃型策略，选股风格以偏向微盘股与大盘价值股的配置，减持了部分赛道类的品种，以追求攻守平衡的效果。二季度我们主要配置了黄金、化工等品种同时坚守了小部分微盘股的配置。在二季度后期，我们认为白马成长股已完成了充分的调整，我们左侧布局了部分白马成长股。回顾来看，黄金、大盘价值部分表现良好，微盘股形成了一定的拖累。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰信均衡价值混合 A 基金份额净值为 0.5999 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.19%；截至本报告期末泰信均衡价值混合 C 基金份额净值为 0.5922 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.41%；同期业绩比较基准收益率为 2.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为主要的看点集中在以下三个方面。首先是国内经济对冲政策将逐步清晰，稳经济、稳增长类的政策是下半年的一大期待。其次，美元降息周期预计将开启，外资在 A 股的持续流出这一问题将得到较好的缓解，我们认为这将为核心资产带来较好的机会。最后，我们认为美国大选是下半年影响市场走势的重要因素，大选结果会对市场的风格带来深远的影响。

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、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；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、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

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

本报告期内本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金管理人已向监管机构报送相关方案。

自 2024 年 5 月 16 日起，本基金产生的信息披露费用、审计费用、持有人大会费用、银行间账户维护费等相关固定费用，由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人

一泰信基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,泰信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,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

本托管人认为,泰信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：泰信均衡价值混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 11,531,001.88 | 10,374,884.70 |
| 结算备付金 | | 205,799.00 | 303,399.57 |
| 存出保证金 | | 21,738.71 | 18,130.82 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 27,622,041.32 | 37,812,495.46 |
| 其中：股票投资 | | 26,431,175.30 | 37,812,495.46 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,190,866.02 | - |
| 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 | | 98,276.39 | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 679.74 | 22,247.63 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 39,479,537.04 | 48,531,158.18 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | 1,032,811.21 |
| 应付赎回款 | | - | 31.25 |
| 应付管理人报酬 | | 39,818.95 | 48,441.42 |
| 应付托管费 | | 6,636.48 | 8,073.59 |
| 应付销售服务费 | | 1,817.62 | 2,351.92 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 8.74 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 50,752.80 | 163,525.54 |
| 负债合计 | | 99,034.59 | 1,255,234.93 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 65,737,524.44 | 71,651,926.87 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | -26,357,021.99 | -24,376,003.62 |
| 净资产合计 | | 39,380,502.45 | 47,275,923.25 |
| 负债和净资产总计 | | 39,479,537.04 | 48,531,158.18 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 65,737,524.44 份。其中：泰信均衡价值混合 A 份额净值人民币 0.5999 元，基金份额总额 58,411,212.61 份；泰信均衡价值混合 C 份额净值人民币 0.5922 元，基金份额总额 7,326,311.83 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信均衡价值混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024年1月1日至2024 年6月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日 |
|------------------------|------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | -3,890,783.71 | -4,134,988.18 |
| 1. 利息收入 | | 37,053.91 | 54,836.69 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 37,053.91 | 54,836.69 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -4,953,041.32 | -8,665,567.37 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -5,282,089.49 | -7,936,504.25 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 1,325.66 | -1,131,208.29 |
| 资产支持证券投资 | 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 | 327,722.51 | 402,145.17 |
| 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 | 1,024,934.95 | 4,472,438.89 |
| 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 | 268.75 | 3,303.61 |
| 减：二、营业总支出 | | 347,163.79 | 717,700.47 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 250,141.91 | 538,944.06 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 41,690.22 | 89,823.99 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 11,556.65 | 20,134.42 |
| 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 | | 4.87 | 4.68 |

| | | | |
|---------------------|----------|---------------|---------------|
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 43,770.14 | 68,793.32 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -4,237,947.50 | -4,852,688.65 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -4,237,947.50 | -4,852,688.65 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -4,237,947.50 | -4,852,688.65 |

6.3 净资产变动表

会计主体：泰信均衡价值混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 | 71,651,926.87 | - | -24,376,003.62 | 47,275,923.25 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 71,651,926.87 | - | -24,376,003.62 | 47,275,923.25 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -5,914,402.43 | - | -1,981,018.37 | -7,895,420.80 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -4,237,947.50 | -4,237,947.50 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -5,914,402.43 | - | 2,256,929.13 | -3,657,473.30 |
| 其中：1. 基金申购款 | 212,809.12 | - | -81,402.16 | 131,406.96 |
| 2. 基金赎回款 | -6,127,211.55 | - | 2,338,331.29 | -3,788,880.26 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|----------------|----------------|
| 资产变动（净资产减少以“-”号填列） | | | | |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 65,737,524.44 | - | -26,357,021.99 | 39,380,502.45 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 | 92,332,402.14 | - | -14,977,954.99 | 77,354,447.15 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 92,332,402.14 | - | -14,977,954.99 | 77,354,447.15 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -11,139,685.76 | - | -3,157,184.44 | -14,296,870.20 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -4,852,688.65 | -4,852,688.65 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -11,139,685.76 | - | 1,695,504.21 | -9,444,181.55 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,874,063.61 | - | -430,783.05 | 2,443,280.56 |
| 2. 基金赎回款 | -14,013,749.37 | - | 2,126,287.26 | -11,887,462.11 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |

| | | | | |
|-----------|---------------|---|----------------|---------------|
| 四、本期期末净资产 | 81,192,716.38 | - | -18,135,139.43 | 63,057,576.95 |
|-----------|---------------|---|----------------|---------------|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|------------|-----------|
| <u>张秉麟</u> | <u>张芸红</u> | <u>顾颖</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信均衡价值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[2021]第 2951 号《关于准予泰信均衡价值混合型证券投资基金注册的批复》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《泰信均衡价值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基金,存续期限为不定期。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 257,555,809.23 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(21)第 00688 号验资报告。《泰信均衡价值混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2021 年 12 月 22 日正式生效。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信均衡价值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,包括国内依法发行或上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票等)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、债券回购、股指期货、货币市场工具、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、现金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)。本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的 35-80%。本基金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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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，对受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 11,531,001.88 |
| 等于：本金 | 11,529,133.74 |
| 加：应计利息 | 1,868.14 |
| 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 | 11,531,001.88 |

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 2024年6月30日 | | | |
|---------------|-------------------|----------|---------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 28,361,209.68 | - | 26,431,175.30 | -1,930,034.38 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 1,705.32 | 1,190,866.02 | 340,175.23 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 1,705.32 | 1,190,866.02 | 340,175.23 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 29,210,195.15 | 1,705.32 | 27,622,041.32 | -1,589,859.15 |

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工具。

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 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 21,025.92 |
| 其中：交易所市场 | 21,025.92 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 29,726.88 |
| 合计 | 50,752.80 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

泰信均衡价值混合 A

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 63,066,688.71 | 63,066,688.71 |
| 本期申购 | 125,662.21 | 125,662.21 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -4,781,138.31 | -4,781,138.31 |
| 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 | 58,411,212.61 | 58,411,212.61 |

泰信均衡价值混合 C

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 8,585,238.16 | 8,585,238.16 |
| 本期申购 | 87,146.91 | 87,146.91 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,346,073.24 | -1,346,073.24 |
| 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 | 7,326,311.83 | 7,326,311.83 |

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

泰信均衡价值混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | -13,660,335.94 | -7,742,767.70 | -21,403,103.64 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -13,660,335.94 | -7,742,767.70 | -21,403,103.64 |
| 本期利润 | -4,672,416.49 | 949,258.87 | -3,723,157.62 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,162,440.65 | 594,672.62 | 1,757,113.27 |
| 其中：基金申购款 | -33,880.50 | -13,609.07 | -47,489.57 |
| 基金赎回款 | 1,196,321.15 | 608,281.69 | 1,804,602.84 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -17,170,311.78 | -6,198,836.21 | -23,369,147.99 |

泰信均衡价值混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | -1,921,295.11 | -1,051,604.87 | -2,972,899.98 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -1,921,295.11 | -1,051,604.87 | -2,972,899.98 |
| 本期利润 | -590,465.96 | 75,676.08 | -514,789.88 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 300,643.28 | 199,172.58 | 499,815.86 |
| 其中：基金申购款 | -23,553.58 | -10,359.01 | -33,912.59 |
| 基金赎回款 | 324,196.86 | 209,531.59 | 533,728.45 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -2,211,117.79 | -776,756.21 | -2,987,874.00 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 35,473.32 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 1,400.36 |
| 其他 | 180.23 |
| 合计 | 37,053.91 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -5,282,089.49 |
| 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 | -5,282,089.49 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 49,328,691.56 |

| | |
|------------|---------------|
| 减：卖出股票成本总额 | 54,511,777.87 |
| 减：交易费用 | 99,003.18 |
| 买卖股票差价收入 | -5,282,089.49 |

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 1,359.60 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -33.94 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 1,325.66 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | - |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | - |
| 减：应计利息总额 | - |
| 减：交易费用 | 33.94 |
| 买卖债券差价收入 | -33.94 |

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 |
|-------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 327,722.51 |
| 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 | 327,722.51 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 1,024,934.95 |
| 股票投资 | 684,759.72 |
| 债券投资 | 340,175.23 |
| 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 | 1,024,934.95 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 256.65 |
| 基金转换费收入 | 12.10 |
| 合计 | 268.75 |

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

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 审计费用 | 11,147.92 |
| 信息披露费 | 18,578.96 |
| 证券出借违约金 | - |

| | |
|-------|-----------|
| 银行费用 | 2,043.26 |
| 账户维护费 | 12,000.00 |
| 合计 | 43,770.14 |

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 | 基金管理人 |
| 中国农业银行股份有限公司（“农业银行”） | 基金托管人 |
| 山东省鲁信投资控股集团有限公司（“鲁信集团”） | 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 |
| 青岛国信产融控股（集团）有限公司（原名：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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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 | 上年度可比期间 |
|------------------|----------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 250,141.91 | 538,944.06 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 120,930.80 | 262,410.79 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 129,211.11 | 276,533.27 |

注：1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×1.20%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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

2、根据《泰信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修订基金合同等事项的公告》，自2023年8月14日起，本基金管理费率由1.50%变更为1.20%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 41,690.22 | 89,823.99 |

注：1、支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

2、根据《泰信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修订基金合同等事项的公告》，自2023年8月14日起，本基金托管费率由0.25%变更为0.20%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|----------------------|------------|------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰信均衡价值混合 A | 泰信均衡价值混合 C | 合计 |
| 泰信基金管理有限公司 | - | 0.15 | 0.15 |

| | | | |
|----------------|----------------------|------------|----------|
| 农业银行 | - | 2,763.62 | 2,763.62 |
| 合计 | - | 2,763.77 | 2,763.77 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰信均衡价值混合 A | 泰信均衡价值混合 C | 合计 |
| 泰信基金管理有限公司 | - | 0.12 | 0.12 |
| 农业银行 | - | 3,510.02 | 3,510.02 |
| 合计 | - | 3,510.14 | 3,510.14 |

注：支付给销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 类份额：支付的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.50% 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：
C 类日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.50%÷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无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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金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 2024年1月1日至2024年6月 30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 |
| 农业银行 | 11,531,001.88 | 35,473.32 | 13,872,706.10 | 53,157.17 |

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，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

本基金本报告期内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（2024 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货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的货币资金存放于本基金的基金托管人农业银行，与该货币资金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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值比例 3.02%(2023 年 12 月 31 日：0.00%)。

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(净资产)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 2024 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 2024 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 39,248,425.87 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货币资金、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 2024 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|---------------|-------|-------|----------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 11,531,001.88 | - | - | - | 11,531,001.88 |
| 结算备付金 | 205,799.00 | - | - | - | 205,799.00 |
| 存出保证金 | 21,738.71 | - | - | - | 21,738.71 |
| 交易性金融资产 | 1,190,866.02 | - | - | -26,431,175.30 | 27,622,041.32 |
| 应收申购款 | - | - | - | 679.74 | 679.74 |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|-------|-------|----------------|---------------|
| 应收清算款 | - | - | - | 98,276.39 | 98,276.39 |
| 资产总计 | 12,949,405.61 | - | - | -26,530,131.43 | 39,479,537.04 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 39,818.95 | 39,818.95 |
| 应付托管费 | - | - | - | 6,636.48 | 6,636.48 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,817.62 | 1,817.62 |
| 应交税费 | - | - | - | 8.74 | 8.74 |
| 其他负债 | - | - | - | 50,752.80 | 50,752.80 |
| 负债总计 | - | - | - | 99,034.59 | 99,034.59 |
| 利率敏感度缺口 | 12,949,405.61 | - | - | -26,431,096.84 | 39,380,502.45 |
| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 10,374,884.70 | - | - | - | 10,374,884.70 |
| 结算备付金 | 303,399.57 | - | - | - | 303,399.57 |
| 存出保证金 | 18,130.82 | - | - | - | 18,130.82 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -37,812,495.46 | 37,812,495.46 |
| 应收申购款 | - | - | - | 22,247.63 | 22,247.63 |
| 资产总计 | 10,696,415.09 | - | - | -37,834,743.09 | 48,531,158.18 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 31.25 | 31.25 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 48,441.42 | 48,441.42 |
| 应付托管费 | - | - | - | 8,073.59 | 8,073.59 |
| 应付清算款 | - | - | - | 1,032,811.21 | 1,032,811.21 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 2,351.92 | 2,351.92 |
| 其他负债 | - | - | - | 163,525.54 | 163,525.54 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,255,234.93 | 1,255,234.93 |
| 利率敏感度缺口 | 10,696,415.09 | - | - | -36,579,508.16 | 47,275,923.25 |

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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资占基金资产净值比例为 3.02% (2023 年 12 月 31 日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 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 2024年6月30日 | | 上年度末 2023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 | 26,431,175.30 | 67.12 | 37,812,495.46 | 79.98 |
| 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 | 26,431,175.30 | 67.12 | 37,812,495.46 | 79.98 |

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（2024年6月30日） | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 1. 业绩比较基准上升 5% | 3,007,647.95 | 2,723,751.85 |
| | 2. 业绩比较基准下降 5% | -3,007,647.95 | -2,723,751.85 |

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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 27,622,041.32 | 37,812,495.46 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 27,622,041.32 | 37,812,495.46 |

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 2024 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若。

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 | 26,431,175.30 | 66.95 |
| | 其中：股票 | 26,431,175.30 | 66.95 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,190,866.02 | 3.02 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 其中：债券 | 1,190,866.02 | 3.02 |
| | 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 | 11,736,800.88 | 29.73 |
| 8 | 其他各项资产 | 120,694.84 | 0.31 |
| 9 | 合计 | 39,479,537.04 | 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 | 11,820,271.00 | 30.02 |
| C | 制造业 | 11,409,956.30 | 28.97 |
| 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 | 732,082.00 | 1.86 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,088,445.00 | 2.76 |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,008,280.00 | 2.56 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 372,141.00 | 0.94 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 26,431,175.30 | 67.12 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

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 | 600489 | 中金黄金 | 248,300 | 3,674,840.00 | 9.33 |
| 2 | 600547 | 山东黄金 | 122,100 | 3,343,098.00 | 8.49 |
| 3 | 605166 | 聚合顺 | 196,000 | 2,056,040.00 | 5.22 |
| 4 | 600988 | 赤峰黄金 | 110,500 | 1,805,570.00 | 4.58 |
| 5 | 300866 | 安克创新 | 18,200 | 1,296,022.00 | 3.29 |
| 6 | 603979 | 金诚信 | 24,400 | 1,232,932.00 | 3.13 |
| 7 | 601899 | 紫金矿业 | 68,800 | 1,208,816.00 | 3.07 |
| 8 | 603966 | 法兰泰克 | 152,600 | 1,048,362.00 | 2.66 |
| 9 | 301073 | 君亭酒店 | 55,400 | 1,008,280.00 | 2.56 |
| 10 | 600612 | 老凤祥 | 16,700 | 971,773.00 | 2.47 |
| 11 | 003011 | 海象新材 | 68,200 | 914,562.00 | 2.32 |
| 12 | 688028 | 沃尔德 | 55,374 | 909,794.82 | 2.31 |
| 13 | 002466 | 天齐锂业 | 25,000 | 747,750.00 | 1.90 |
| 14 | 002352 | 顺丰控股 | 20,700 | 738,783.00 | 1.88 |
| 15 | 600916 | 中国黄金 | 76,100 | 732,082.00 | 1.86 |
| 16 | 688367 | 工大高科 | 56,681 | 691,508.20 | 1.76 |
| 17 | 002176 | 江特电机 | 68,100 | 555,015.00 | 1.41 |
| 18 | 002594 | 比亚迪 | 1,900 | 475,475.00 | 1.21 |
| 19 | 688722 | 同益中 | 40,000 | 447,600.00 | 1.14 |
| 20 | 605499 | 东鹏饮料 | 1,900 | 409,925.00 | 1.04 |
| 21 | 601801 | 皖新传媒 | 53,700 | 372,141.00 | 0.94 |
| 22 | 002812 | 恩捷股份 | 11,400 | 360,810.00 | 0.92 |
| 23 | 603128 | 华贸物流 | 60,600 | 349,662.00 | 0.89 |
| 24 | 688696 | 极米科技 | 4,017 | 310,273.08 | 0.79 |
| 25 | 600519 | 贵州茅台 | 200 | 293,478.00 | 0.75 |
| 26 | 600160 | 巨化股份 | 10,700 | 258,191.00 | 0.66 |
| 27 | 301068 | 大地海洋 | 10,530 | 218,392.20 | 0.55 |

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 | 300933 | 中辰股份 | 3,140,575.00 | 6.64 |
| 2 | 603186 | 华正新材 | 2,059,253.00 | 4.36 |
| 3 | 688456 | 有研粉材 | 2,056,785.92 | 4.35 |
| 4 | 300379 | 东方通 | 2,042,838.33 | 4.32 |
| 5 | 002897 | 意华股份 | 1,917,778.00 | 4.06 |
| 6 | 002466 | 天齐锂业 | 1,707,750.00 | 3.61 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 7 | 600612 | 老凤祥 | 1,652,190.00 | 3.49 |
| 8 | 301073 | 君亭酒店 | 1,560,265.50 | 3.30 |
| 9 | 601888 | 中国中免 | 1,300,312.00 | 2.75 |
| 10 | 603966 | 法兰泰克 | 1,295,323.00 | 2.74 |
| 11 | 002176 | 江特电机 | 1,290,227.00 | 2.73 |
| 12 | 603979 | 金诚信 | 1,271,826.54 | 2.69 |
| 13 | 002244 | 滨江集团 | 1,259,755.00 | 2.66 |
| 14 | 601899 | 紫金矿业 | 1,256,986.00 | 2.66 |
| 15 | 600048 | 保利发展 | 1,246,111.00 | 2.64 |
| 16 | 300866 | 安克创新 | 1,231,874.00 | 2.61 |
| 17 | 300308 | 中际旭创 | 1,217,713.00 | 2.58 |
| 18 | 603156 | 养元饮品 | 1,172,988.00 | 2.48 |
| 19 | 601328 | 交通银行 | 1,160,263.00 | 2.45 |
| 20 | 603259 | 药明康德 | 1,116,426.00 | 2.36 |
| 21 | 601801 | 皖新传媒 | 977,355.00 | 2.07 |

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 | 300274 | 阳光电源 | 3,430,655.00 | 7.26 |
| 2 | 300933 | 中辰股份 | 2,964,497.00 | 6.27 |
| 3 | 688722 | 同益中 | 2,360,420.20 | 4.99 |
| 4 | 002897 | 意华股份 | 2,147,488.18 | 4.54 |
| 5 | 688456 | 有研粉材 | 1,816,257.83 | 3.84 |
| 6 | 002594 | 比亚迪 | 1,772,436.00 | 3.75 |
| 7 | 603186 | 华正新材 | 1,740,045.00 | 3.68 |
| 8 | 300379 | 东方通 | 1,688,775.00 | 3.57 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 1,550,340.00 | 3.28 |
| 10 | 002466 | 天齐锂业 | 1,468,324.00 | 3.11 |
| 11 | 603156 | 养元饮品 | 1,302,009.00 | 2.75 |
| 12 | 601888 | 中国中免 | 1,270,892.00 | 2.69 |
| 13 | 600048 | 保利发展 | 1,224,283.00 | 2.59 |
| 14 | 601328 | 交通银行 | 1,174,119.00 | 2.48 |
| 15 | 002244 | 滨江集团 | 1,164,114.00 | 2.46 |
| 16 | 002738 | 中矿资源 | 1,113,389.05 | 2.36 |
| 17 | 300308 | 中际旭创 | 1,112,025.00 | 2.35 |
| 18 | 600160 | 巨化股份 | 1,101,781.00 | 2.33 |
| 19 | 000762 | 西藏矿业 | 1,090,612.00 | 2.31 |
| 20 | 002352 | 顺丰控股 | 1,058,281.00 | 2.24 |
| 21 | 603259 | 药明康德 | 947,922.00 | 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 | 42,445,697.99 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 49,328,691.56 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,190,866.02 | 3.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,190,866.02 | 3.02 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|--------------|--------------|
| 1 | 113615 | 金诚转债 | 2,730 | 1,190,866.02 | 3.02 |

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

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

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

本报告期内本基金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，或在本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没有超出基金合同规定备选股票库的情形。

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 | 21,738.71 |
| 2 | 应收清算款 | 98,276.39 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 679.74 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 120,694.84 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 113615 | 金诚转债 | 1,190,866.02 | 3.02 |

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

| 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 (%) |
| 泰信均衡价值混合 A | 1,220 | 47,878.04 | 4,964,125.65 | 8.50 | 53,447,086.96 | 91.50 |
| 泰信均衡价值混合 C | 251 | 29,188.49 | 0.00 | 0.00 | 7,326,311.83 | 100.00 |
| 合计 | 1,471 | 44,689.00 | 4,964,125.65 | 7.55 | 60,773,398.79 | 92.45 |

8.2 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份额。

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 | 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 泰信均衡价值混合 A | 0 |
| | 泰信均衡价值混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 泰信均衡价值混合 A | 0 |
| | 泰信均衡价值混合 C | 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 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 泰信均衡价值混合 A | 泰信均衡价值混合 C |
|-----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2021 年 12 月 22) | 151,738,701.15 | 105,817,108.08 |

| | | |
|----------------|---------------|--------------|
| 日) 基金份额总额 | | |
| 本报告期期初基金份额总额 | 63,066,688.71 | 8,585,238.16 |
| 本报告期基金总申购份额 | 125,662.21 | 87,146.91 |
| 减: 本报告期基金总赎回份额 | 4,781,138.31 | 1,346,073.24 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 58,411,212.61 | 7,326,311.83 |

注: 总申购份额含红利再投资、转换入份额; 总赎回份额含转换出份额。

§ 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 2024 年 1 月 4 日起, 张芸红女士任公司首席财务官职务。具体详情参见 2024 年 1 月 6 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高级管理人员变更公告》。

2、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过, 自 2024 年 2 月 19 日起, 张秉麟先生任公司总经理职务, 董事长李高峰先生不再担任总经理职务。具体详情参见 2024 年 2 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高级管理人员变更公告》。

3、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过, 自 2024 年 2 月 19 日起, 王弓箭先生任公司副总经理职务。具体详情参见 2024 年 2 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高级管理人员变更公告》。

4、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过, 自 2024 年 5 月 13 日起, 岳红婷女士不再任公司副总经理职务。具体详情参见 2024 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高级管理人员变更公告》。

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。

10.3 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。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

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 (%) | |
| 上海证券 | 2 | 91,774,389.55 | 100.00 | 68,454.73 | 100.00 | - |

注：1、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、财务状况、处罚情况、内部控制等。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、研究服务质量进行定期评估。公司将根据对券商服务的考评排名结果，决定交易席位的分配和调整。

2、本报告期新增交易单元：无；退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |

| | | | | | | |
|----------|------------|--------|---|---|---|---|
| 上海证 券 | 849,290.63 | 100.00 | - | - | - | - |
|----------|------------|--------|---|---|---|---|

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|--------------|-----------------|
| 1 | 泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《上海证券报》、规定网站 | 2024 年 1 月 6 日 |
| 2 | 关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为销售机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、规定网站 | 2024 年 1 月 12 日 |
| 3 | 泰信均衡价值混合型证券投资基金 2023 年第四季度报告 | 《上海证券报》、规定网站 | 2024 年 1 月 19 日 |
| 4 | 泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《上海证券报》、规定网站 | 2024 年 2 月 20 日 |
| 5 | 泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《上海证券报》、规定网站 | 2024 年 2 月 20 日 |
| 6 | 泰信均衡价值混合型证券投资基金 2023 年年度报告 | 《上海证券报》、规定网站 | 2024 年 3 月 28 日 |
| 7 | 泰信均衡价值混合型证券投资基金 2024 年第一季度报告 | 《上海证券报》、规定网站 | 2024 年 4 月 19 日 |
| 8 | 泰信基金管理有限公司深圳分公司营业场所变更公告 | 《上海证券报》、规定网站 | 2024 年 5 月 14 日 |
| 9 | 泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《上海证券报》、规定网站 | 2024 年 5 月 15 日 |
| 10 | 泰信均衡价值混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 《上海证券报》、规定网站 | 2024 年 6 月 7 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均衡价值混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信均衡价值混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信均衡价值混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信均衡价值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、基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

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

2024 年 8 月 29 日