

# 泰信智选成长灵活配置混合型证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 28 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 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12        |
| 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.....             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13        |
| 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.....                 | 14        |
| 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.....       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 15        |
| 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..... | 15        |
| 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.....      | 15        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 16        |
| 6.2 利润表.....                                 | 17        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 18        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 19        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 37        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 37        |
| 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.....     | 38        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 40        |
| 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.....    | 40        |
| 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..... | 40        |
| 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..... | 40        |
| 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.....    | 41        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 41        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 41        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 41        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>43</b> |
| 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的情况.....     | 43        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>44</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 45        |
| 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.....      | 45        |
| 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        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>49</b> |
| 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.....    | 49        |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 49        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>   | <b>50</b> |
| 12.1 备查文件目录.....         | 50        |
| 12.2 存放地点.....           | 50        |
| 12.3 查阅方式.....           | 50        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 泰信智选成长混合            |
| 基金主代码      | 003333              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2016 年 12 月 21 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 | 21,726,193.57 份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下，通过相对灵活的资产配置，重点投资于受益于中国经济发展而快速成长的上市公司，谋求基金资产的长期、稳定增值。                              |
| 投资策略   | 本基金将结合“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×60%+上证国债指数收益率×40%   |
| 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 华夏银行大厦 36-37 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |

|       |        |        |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码  | 200120 | 100140 |
| 法定代表人 | 万众     | 陈四清    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                |
|---------------------|----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》         |
| 登载基金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 号华夏银行大厦 36、37 层 |

### § 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(2021年1月1日 - 2021年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,210,049.84                |
| 本期利润          | 6,045,730.95                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2576                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 24.59%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 24.94%                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日)            |
| 期末可供分配利润      | -127,929.71                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0059                     |
| 期末基金资产净值      | 26,885,034.88               |
| 期末基金份额净值      | 1.2374                      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021年6月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | 23.74%                      |

#### 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      | 7.37%    | 1.58%       | -1.15%     | 0.49%         | 8.52%   | 1.09% |
| 过去三个月      | 30.20%   | 1.50%       | 2.49%      | 0.59%         | 27.71%  | 0.91% |
| 过去六个月      | 24.94%   | 1.72%       | 1.06%      | 0.79%         | 23.88%  | 0.93% |
| 过去一年       | 32.02%   | 1.65%       | 16.29%     | 0.80%         | 15.73%  | 0.85% |
| 过去三年       | 47.57%   | 1.49%       | 35.49%     | 0.82%         | 12.08%  | 0.67% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.74%   | 1.32%       | 42.92%     | 0.73%         | -19.18% | 0.59% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

1、沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 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。

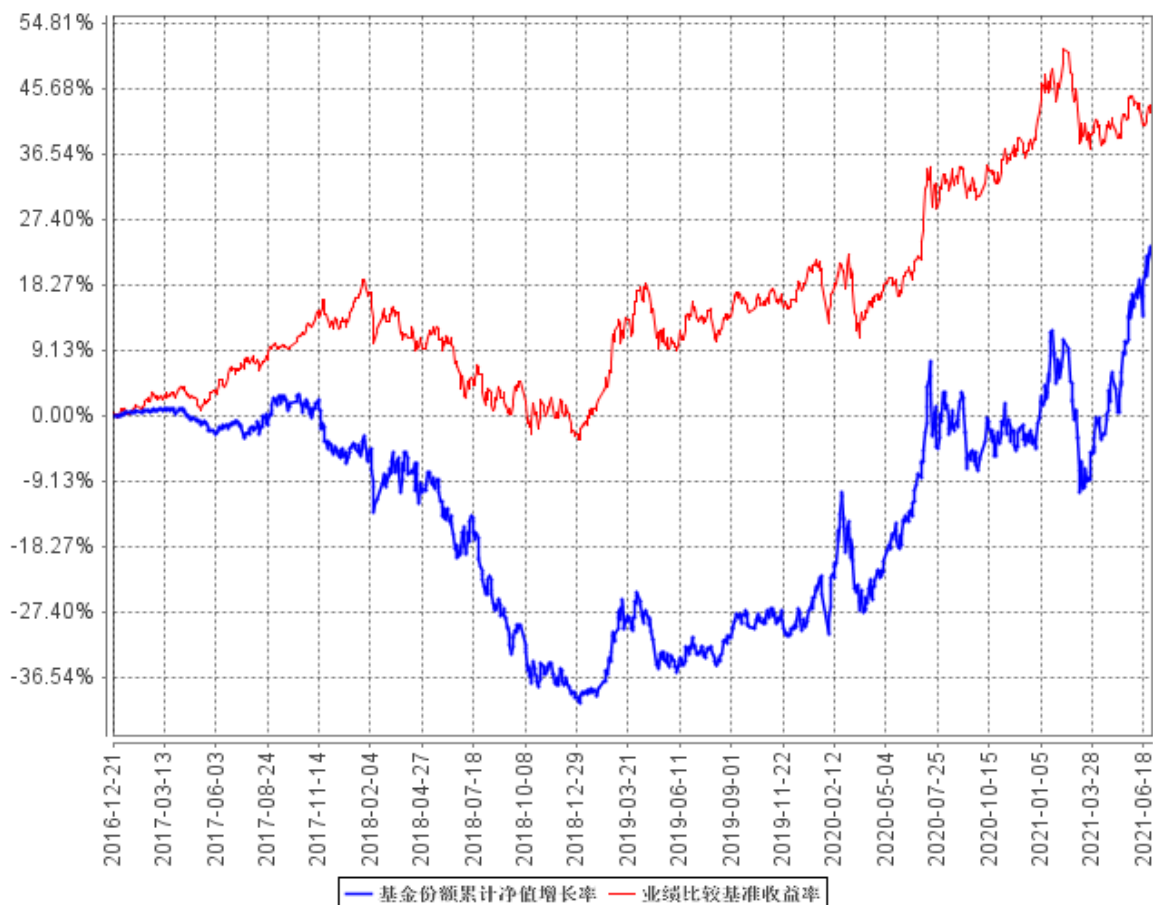
2、上证国债指数样本涵盖了上海证券交易所所有的国债品种，交易所的国债交易市场具有参与主体丰富、竞价交易连续的特性，能反映出市场利率的瞬息变化，也使得上证国债指数能真实地标



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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 21 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定，股票资产占基金资产的 0%-95%，投资于成长主题的证券资产不低于本基金非现金基金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，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%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：万众

总经理：高宇

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：姚慧

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是“好人举手”制度下，获准筹建的第一家以信托公司为主发起人的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、营销支持中心、产品研发部、渠道服务部、战略客户部、机构业务部、深圳分公司、北京分公司、金融科技部、权益投资部、固收投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2021 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 2021 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、泰信鑫利混合、泰信竞争优选混合、泰信双债增利债券、泰信景气驱动 12 个月持有期共 23 只开放式基金及 27 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 |        |   |
| 朱志权先生 | 权益投资部副总监、泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理   | 2016年12月21日     | -    | 26年    | 朱志权先生，上海财经大学金融证券专业学士。历任农行湖北信托上海证券业务部职员、中信证券上海总部职员、长盛基金管理有限公司职员、富国基金管理有限公司基金经理助理、中海信托管理有限公司职员、银河基金管理有限公司高级研究员。2008年6月加入泰信基金管理有限公司，现任权益投资部副总监。2008年6月至2012年3月任泰信优质生活混合型证券投资基金基金经理，2012年3月至2015年2月任泰信先行策略开放式证券投资基金基金经理，2010年1月至今任泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年12月至今任泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年8月至今兼任公司旗下资产管理计划投资经理。 |
| 张彦先生  | 泰信中证200指数证券投资基金基金经理、泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金(LOF)(原泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金)基金经理、泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2017年11月15日     | -    | 15年    | 张彦先生，同济大学产业经济学专业硕士。历任百联集团投资经理助理、国金证券研究所研究员、上海从容投资管理有限公司研究员、万家基金管理有限公司研究员。2011年6月加入泰信基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理。2015年1月至今任泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金(LOF)基金经理(原泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金转型)，2015   |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 年 1 月至今任泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至今任泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、任职日期为合同生效日或公告日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

| 姓名  | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值（元）        | 任职时间       |
|-----|----------|---------|----------------|------------|
| 朱志权 | 公募基金     | 2       | 89,696,529.61  | 2008-06-28 |
|     | 私募资产管理计划 | 1       | 56,344,430.35  | 2020-08-13 |
|     | 其他组合     | -       | -              | -          |
|     | 合计       | 3       | 146,040,959.96 | -          |

#### 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》、《泰信智选成长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

2021 年上半年在经历了以茅指数为代表的核心资产大幅调整充分消化估值后，市场止跌反弹，其中成长属性突出、代表未来产业发展方向的宁组合指数领跑市场。分行业看，基础化工、钢铁、电力设备新能源表现强势，电子、医药、汽车等行业涨幅靠前，房地产、家电、非银等行业跌幅较大。

报告期内，本基金的大部分资产秉承基金契约精神，以具有突出产业竞争力的成长股作为主要投资标的，在稳健的前提下，确保投资者利益。

### 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 1.2374 元；本报告期基金份额净值增长率为 24.94%，业绩比较基准收益率为 1.06%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度虽然有印度疫情大爆发、德尔塔变异新冠病毒肆虐引发全球疫情再发酵的担忧，但随着新冠疫苗的广泛接种，我们判断全球经济仍处于恢复阶段，考虑到呵护经济的必要性，全球流动性并未进一步紧缩。国内宏观经济方面，下半年国内经济压力仍存，预计货币政策仍然保持流动性合理充裕，但货币支持从宏观转向局部，边际上有所减弱。

对证券市场而言，我们认为当前及未来一段时间证券市场仍然演绎结构化的行情，成长属性突出、代表未来产业发展方向的医药先进制造、新能源、光伏、半导体等领域市场表现靓丽，而受国家政策打压预期影响的仿制药、高值耗材、房地产等领域表现差。

基于以上判断，本基金权益配置方向将继续维持在成长属性突出、代表未来产业发展方向的领域，继续维持以核心竞争力突出、估值合理的投资标的为核心持仓结构，保持组合的流动性和稳定性。

## 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

本报告期本基金于 2021 年 1 月 4 日至 2021 年 6 月 30 日有连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。基金管理人已向中国证监会报告此情形并将采取适当措施。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本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泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金 2021 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：泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 2,460,317.17                   | 1,872,282.31                     |
| 结算备付金           |            | 534.34                         | 89,777.92                        |
| 存出保证金           |            | 7,847.36                       | 12,998.41                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 24,369,496.35                  | 27,704,868.13                    |
| 其中：股票投资         |            | 24,369,496.35                  | 27,035,618.13                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | -                              | 669,250.00                       |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 229.45                         | 2,669.53                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 113,584.54                     | 2,319.85                         |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 26,952,009.21                  | 29,684,916.15                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 8,496.18                       | 2,404.91                         |
| 应付管理人报酬         |            | 31,960.02                      | 39,841.16                        |
| 应付托管费           |            | 5,326.68                       | 6,640.19                         |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 3,231.80                       | 51,840.08                        |
| 应交税费            |            | -                              | 9.66                             |



|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利息          |          | -             | -             |
| 应付利润          |          | -             | -             |
| 递延所得税负债       |          | -             | -             |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 17,959.65     | 116,206.12    |
| 负债合计          |          | 66,974.33     | 216,942.12    |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 21,726,193.57 | 29,752,771.85 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 5,158,841.31  | -284,797.82   |
| 所有者权益合计       |          | 26,885,034.88 | 29,467,974.03 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 26,952,009.21 | 29,684,916.15 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2374 元，基金份额总额 21,726,193.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 6,317,061.28                             | 14,507,789.58                                 |
| 1.利息收入                |            | 5,180.20                                 | 25,542.29                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 5,093.38                                 | 22,713.52                                     |
| 债券利息收入                |            | 86.82                                    | 2,828.77                                      |
| 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）      |            | 2,470,241.96                             | 3,776,241.00                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 2,348,706.84                             | 3,181,201.20                                  |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 26,890.94                                | 440,095.36                                    |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.3 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 94,644.18                                | 154,944.44                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 3,835,681.11                             | 10,700,140.68                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 5,958.01                                 | 5,865.61                                      |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 271,330.33                               | 809,855.85                                    |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 183,396.56                               | 386,975.83                                    |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 30,566.14                                | 64,495.95                                     |

|                            |            |              |               |
|----------------------------|------------|--------------|---------------|
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -            | -             |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 30,178.74    | 279,476.15    |
| 5. 利息支出                    |            | -            | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -            | -             |
| 6. 税金及附加                   |            | 0.31         | 10.10         |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 27,188.58    | 78,897.82     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 6,045,730.95 | 13,697,933.73 |
| 减：所得税费用                    |            | -            | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 6,045,730.95 | 13,697,933.73 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |              |                |
|--|--|--------------|----------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润        | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 29,752,771.85                              | -284,797.82  | 29,467,974.03  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 6,045,730.95 | 6,045,730.95   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -8,026,578.28                              | -602,091.82  | -8,628,670.10  |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,337,934.17                               | 243,654.11   | 2,581,588.28   |
| 2.基金赎回款                                | -10,364,512.45                             | -845,745.93  | -11,210,258.38 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -            | -              |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 21,726,193.57                              | 5,158,841.31 | 26,885,034.88  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |              |                |

|  | 实收基金           | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 68,590,123.84  | -19,349,296.72 | 49,240,827.12  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -              | 13,697,933.73  | 13,697,933.73  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -11,652,531.35 | 2,081,914.68   | -9,570,616.67  |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,129,575.26   | -392,358.74    | 1,737,216.52   |
| 2.基金赎回款                                | -13,782,106.61 | 2,474,273.42   | -11,307,833.19 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -              | -              | -              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 56,937,592.49  | -3,569,448.31  | 53,368,144.18  |

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
叶振宇

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
叶振宇

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰信智选成长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[2016]第 1958 号《关于准予泰信智选成长灵活配置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《泰信智选成长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 348,059,789.82 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(2016)第 1685 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 348,189,279.94 份基金份额，其中认购资金利息折合 129,490.12 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《泰信智选成长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(含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券等)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单)、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%，投资于成长主题的证券资产不低于本基金非现金基金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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×60%+上证国债指数收益率×40%。

#### 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的会计政策变更。

### 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会计差错更正。

## 6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

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

## 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>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,460,317.17           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 2,460,317.17           |

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<br>2021 年 6 月 30 日 |               |               |
|---------------|------------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 11,108,042.20          | 24,369,496.35 | 13,261,454.15 |
| 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 | 11,108,042.20 | 24,369,496.35 | 13,261,454.15 |

#### 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资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 226.12            |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 0.18              |
| 应收债券利息     | -                 |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 应收出借证券利息   | -                 |
| 其他         | 3.15              |
| 合计         | 229.45            |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|             | 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 3,231.80        |
| 银行间市场应付交易费用 | -               |
| 合计          | 3,231.80        |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 8.07                   |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 17,951.58              |
| 合计          | 17,959.65              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 29,752,771.85                         | 29,752,771.85  |
| 本期申购          | 2,337,934.17                          | 2,337,934.17   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -10,364,512.45                        | -10,364,512.45 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -              |
| 本期末           | 21,726,193.57                         | 21,726,193.57  |

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。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计      |
|----------------|---------------|---------------|--------------|
| 上年度末           | -2,873,985.85 | 2,589,188.03  | -284,797.82  |
| 本期利润           | 2,210,049.84  | 3,835,681.11  | 6,045,730.95 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 536,006.30    | -1,138,098.12 | -602,091.82  |
| 其中：基金申购款       | -53,228.06    | 296,882.17    | 243,654.11   |



|         |             |               |              |
|---------|-------------|---------------|--------------|
| 基金赎回款   | 589,234.36  | -1,434,980.29 | -845,745.93  |
| 本期已分配利润 | -           | -             | -            |
| 本期末     | -127,929.71 | 5,286,771.02  | 5,158,841.31 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 4,861.55                   |
| 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 | 135.54                     |
| 其他        | 96.29                      |
| 合计        | 5,093.38                   |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 13,429,689.58              |
| 减：卖出股票成本总额 | 11,080,982.74              |
| 买卖股票差价收入   | 2,348,706.84               |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 26,890.94                  |
| 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                            | 26,890.94                  |

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 690,651.50                 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 661,233.87                 |
| 减：应收利息总额                | 2,526.69                   |
| 买卖债券差价收入                | 26,890.94                  |

**6.4.7.13.3 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。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 94,644.18                  |
| 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            | 94,644.18                  |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 3,835,681.11               |
| ——股票投资     | 3,843,697.24               |
| ——债券投资     | -8,016.13                  |
| ——资产支持证券投资 | -                          |
| ——贵金属投资    | -                          |

|                            |              |
|----------------------------|--------------|
| ——其他                       | -            |
| 2. 衍生工具                    | -            |
| ——权证投资                     | -            |
| 3. 其他                      | -            |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -            |
| 合计                         | 3,835,681.11 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 5,538.15                        |
| 转出基金补偿费 | 419.86                          |
| 合计      | 5,958.01                        |

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。

注 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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 交易所市场交易费用 | 30,178.74                       |
| 银行间市场交易费用 | -                               |
| 交易基金产生的费用 | -                               |
| 其中：申购费    | -                               |
| 赎回费       | -                               |
| 合计        | 30,178.74                       |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|         | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------|
| 审计费用    | 17,951.58                       |
| 信息披露费   | -                               |
| 证券出借违约金 | -                               |
| 银行划款手续费 | 237.00                          |
| 账户服务费   | 9,000.00                        |
| 合计      | 27,188.58                       |

#### 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、基金销售机构、注册登记机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |
| 山东省国际信托股份有限公司（“山东国托”）  | 基金管理人的股东            |
| 江苏省投资管理有限责任公司          | 基金管理人的股东            |
| 青岛国信实业有限公司             | 基金管理人的股东            |
| 上海锐懿资产管理有限公司           | 基金管理人的子公司           |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未进行关联交易。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 183,396.56                     | 386,975.83                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 77,829.26                      | 134,565.03                      |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提本基金的管理费，管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 30,566.14                  | 64,495.95                       |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提本基金的托管费，托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间未发生销售服务费用。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30<br>日 |
|-------------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额             | 2,904,400.00                   | 10,004,400.00                       |
| 报告期间申购/买入总份额            | -                              | -                                   |
| 报告期间因拆分变动份额             | -                              | -                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份<br>额      | -                              | 6,500,000.00                        |
| 报告期末持有的基金份额             | 2,904,400.00                   | 3,504,400.00                        |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 13.37%                         | 6.15%                               |

注：基金管理人运用自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>2021年1月1日至2021年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020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 | 2,460,317.17               | 4,861.55 | 3,321,449.02                    | 21,002.60 |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因 | 期末<br>估值单<br>价 | 复牌日期      | 复牌<br>开盘单<br>价 | 数量<br>(股) | 期末<br>成本总额 | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|------|----------------|-----------|----------------|-----------|------------|--------------|----|
| 688368 | 晶丰明源 | 2021年6月21日 | 重大事项 | 335.26         | 2021年7月5日 | 402.31         | 3,000     | 282,978.34 | 1,005,780.00 | -  |

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事正回购交易作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 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参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

#### 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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有债券(2020 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 2.27%)。

#### 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(所有者权益)无固定到期日且不计息。

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 3.7410%。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 2021 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 25,824,033.52 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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>2021年6月30<br>日 | 1年以内         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|-----------------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产                    |              |      |      |               |               |
| 银行存款                  | 2,460,317.17 | -    | -    | -             | 2,460,317.17  |
| 结算备付金                 | 534.34       | -    | -    | -             | 534.34        |
| 存出保证金                 | 7,847.36     | -    | -    | -             | 7,847.36      |
| 交易性金融资产               | -            | -    | -    | 24,369,496.35 | 24,369,496.35 |
| 应收利息                  | -            | -    | -    | 229.45        | 229.45        |
| 应收申购款                 | -            | -    | -    | 113,584.54    | 113,584.54    |
| 资产总计                  | 2,468,698.87 | -    | -    | 24,483,310.34 | 26,952,009.21 |
| 负债                    |              |      |      |               |               |
| 应付赎回款                 | -            | -    | -    | 8,496.18      | 8,496.18      |
| 应付管理人报酬               | -            | -    | -    | 31,960.02     | 31,960.02     |
| 应付托管费                 | -            | -    | -    | 5,326.68      | 5,326.68      |
| 应付交易费用                | -            | -    | -    | 3,231.80      | 3,231.80      |
| 其他负债                  | -            | -    | -    | 17,959.65     | 17,959.65     |
| 负债总计                  | -            | -    | -    | 66,974.33     | 66,974.33     |
| 利率敏感度缺口               | 2,468,698.87 | -    | -    | 24,416,336.01 | 26,885,034.88 |
| 上年度末                  | 1年以内         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |

|                  |              |            |   |               |               |
|------------------|--------------|------------|---|---------------|---------------|
| 2020 年 12 月 31 日 |              |            |   |               |               |
| 资产               |              |            |   |               |               |
| 银行存款             | 1,872,282.31 | -          | - | -             | 1,872,282.31  |
| 结算备付金            | 89,777.92    | -          | - | -             | 89,777.92     |
| 存出保证金            | 12,998.41    | -          | - | -             | 12,998.41     |
| 交易性金融资产          | -            | 669,250.00 | - | 27,035,618.13 | 27,704,868.13 |
| 应收利息             | -            | -          | - | 2,669.53      | 2,669.53      |
| 应收申购款            | -            | -          | - | 2,319.85      | 2,319.85      |
| 资产总计             | 1,975,058.64 | 669,250.00 | - | 27,040,607.51 | 29,684,916.15 |
| 负债               |              |            |   |               |               |
| 应付赎回款            | -            | -          | - | 2,404.91      | 2,404.91      |
| 应付管理人报酬          | -            | -          | - | 39,841.16     | 39,841.16     |
| 应付托管费            | -            | -          | - | 6,640.19      | 6,640.19      |
| 应付交易费用           | -            | -          | - | 51,840.08     | 51,840.08     |
| 应交税费             | -            | -          | - | 9.66          | 9.66          |
| 其他负债             | -            | -          | - | 116,206.12    | 116,206.12    |
| 负债总计             | -            | -          | - | 216,942.12    | 216,942.12    |
| 利率敏感度缺口          | 1,975,058.64 | 669,250.00 | - | 26,823,665.39 | 29,467,974.03 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券(2020 年 12 月 31 日：2.27%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 24,369,496.35          | 90.64                    | 27,035,618.13            | 91.75                 |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-债券投资  | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 其他            | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 合计            | 24,369,496.35          | 90.64                    | 27,035,618.13            | 91.75                 |

## 6.4.13.4.3.2 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（2021 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|                | 1. 业绩比较基准上升 5%        | 1,546,968.18                | 2,518,666.37           |
| 2. 业绩比较基准下降 5% | -1,546,968.18         | -2,518,666.37               |                        |

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 24,369,496.35 | 90.42         |
|    | 其中：股票             | 24,369,496.35 | 90.42         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -             |
|    | 其中：债券             | -             | -             |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 2,460,851.51  | 9.13          |
| 8  | 其他各项资产            | 121,661.35    | 0.45          |
| 9  | 合计                | 26,952,009.21 | 100.00        |

### 7.2 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              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 11,890,890.63 | 44.23         |
| 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  | 3,661,880.00  | 13.62         |
| J  | 金融业              | 550,872.00    | 2.05          |
| 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       | 5,724,438.00  | 21.29         |
| 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   | 2,494,045.72  | 9.28  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 47,370.00     | 0.18  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 24,369,496.35 | 90.64 |

### 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         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 603127 | 昭衍新药 | 14,000  | 2,572,500.00 | 9.57         |
| 2  | 002371 | 北方华创 | 9,000   | 2,496,420.00 | 9.29         |
| 3  | 300015 | 爱尔眼科 | 32,414  | 2,300,745.72 | 8.56         |
| 4  | 002821 | 凯莱英  | 6,000   | 2,235,600.00 | 8.32         |
| 5  | 603259 | 药明康德 | 13,200  | 2,066,988.00 | 7.69         |
| 6  | 603156 | 养元饮品 | 50,500  | 1,443,290.00 | 5.37         |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 700     | 1,439,690.00 | 5.35         |
| 8  | 600584 | 长电科技 | 30,000  | 1,130,400.00 | 4.20         |
| 9  | 300759 | 康龙化成 | 5,000   | 1,084,950.00 | 4.04         |
| 10 | 688368 | 晶丰明源 | 3,000   | 1,005,780.00 | 3.74         |
| 11 | 600570 | 恒生电子 | 10,000  | 932,500.00   | 3.47         |
| 12 | 300595 | 欧普康视 | 8,400   | 869,820.00   | 3.24         |
| 13 | 688356 | 键凯科技 | 2,304   | 756,864.00   | 2.82         |
| 14 | 002230 | 科大讯飞 | 10,000  | 675,800.00   | 2.51         |
| 15 | 002185 | 华天科技 | 40,000  | 615,600.00   | 2.29         |
| 16 | 300059 | 东方财富 | 16,800  | 550,872.00   | 2.05         |
| 17 | 300762 | 上海瀚讯 | 16,000  | 452,000.00   | 1.68         |
| 18 | 300315 | 掌趣科技 | 100,000 | 425,000.00   | 1.58         |
| 19 | 300799 | 左江科技 | 6,000   | 328,800.00   | 1.22         |
| 20 | 002049 | 紫光国微 | 2,000   | 308,380.00   | 1.15         |
| 21 | 002405 | 四维图新 | 20,000  | 294,000.00   | 1.09         |
| 22 | 300347 | 泰格医药 | 1,000   | 193,300.00   | 0.72         |
| 23 | 002340 | 格林美  | 10,000  | 93,500.00    | 0.35         |
| 24 | 002739 | 万达电影 | 3,000   | 47,370.00    | 0.18         |
| 25 | 688006 | 杭可科技 | 500     | 42,500.00    | 0.16         |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 26 | 003036 | 泰坦股份 | 443 | 6,826.63 | 0.03 |
|----|--------|------|-----|----------|------|

## 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  | 600519 | 贵州茅台 | 1,472,214.00 | 5.00            |
| 2  | 600570 | 恒生电子 | 304,420.00   | 1.03            |
| 3  | 002791 | 坚朗五金 | 295,456.00   | 1.00            |
| 4  | 000039 | 中集集团 | 284,249.46   | 0.96            |
| 5  | 002049 | 紫光国微 | 281,440.00   | 0.96            |
| 6  | 002311 | 海大集团 | 238,034.00   | 0.81            |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 210,380.00   | 0.71            |
| 8  | 600096 | 云天化  | 208,800.00   | 0.71            |
| 9  | 601088 | 中国神华 | 190,100.00   | 0.65            |
| 10 | 000799 | 酒鬼酒  | 182,847.00   | 0.62            |
| 11 | 601888 | 中国中免 | 160,150.00   | 0.54            |
| 12 | 605358 | 立昂微  | 151,152.00   | 0.51            |
| 13 | 300347 | 泰格医药 | 141,100.00   | 0.48            |
| 14 | 000661 | 长春高新 | 93,800.00    | 0.32            |
| 15 | 002340 | 格林美  | 93,000.00    | 0.32            |
| 16 | 000030 | 富奥股份 | 79,100.00    | 0.27            |
| 17 | 002739 | 万达电影 | 58,020.00    | 0.20            |
| 18 | 601633 | 长城汽车 | 42,963.00    | 0.15            |
| 19 | 688006 | 杭可科技 | 38,400.00    | 0.13            |
| 20 | 601899 | 紫金矿业 | 22,291.00    | 0.08            |

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

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额   | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|-----------------|
| 1  | 300059 | 东方财富 | 690,502.80 | 2.34            |
| 2  | 688368 | 晶丰明源 | 644,795.00 | 2.19            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 3  | 300762 | 上海瀚讯 | 639,617.00 | 2.17 |
| 4  | 300595 | 欧普康视 | 612,124.00 | 2.08 |
| 5  | 000977 | 浪潮信息 | 595,971.00 | 2.02 |
| 6  | 603801 | 志邦家居 | 584,873.00 | 1.98 |
| 7  | 002185 | 华天科技 | 570,000.00 | 1.93 |
| 8  | 600926 | 杭州银行 | 553,600.00 | 1.88 |
| 9  | 601238 | 广汽集团 | 505,200.00 | 1.71 |
| 10 | 603087 | 甘李药业 | 472,448.00 | 1.60 |
| 11 | 002648 | 卫星石化 | 412,813.00 | 1.40 |
| 12 | 603138 | 海量数据 | 411,822.00 | 1.40 |
| 13 | 688088 | 虹软科技 | 397,840.00 | 1.35 |
| 14 | 603019 | 中科曙光 | 390,303.00 | 1.32 |
| 15 | 002791 | 坚朗五金 | 345,065.00 | 1.17 |
| 16 | 000858 | 五粮液  | 323,418.00 | 1.10 |
| 17 | 002601 | 龙佰集团 | 304,349.00 | 1.03 |
| 18 | 000002 | 万科 A | 297,000.00 | 1.01 |
| 19 | 688116 | 天奈科技 | 292,101.27 | 0.99 |
| 20 | 002230 | 科大讯飞 | 289,100.00 | 0.98 |

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 | 4,571,163.72  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 13,429,689.58 |

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

本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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 7,847.36   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 229.45     |
| 5  | 应收申购款   | 113,584.54 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 121,661.35 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1  | 688368 | 晶丰明源 | 1,005,780.00 | 3.74          | 重大事项     |

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 684          | 31,763.44     | 2,904,400.00 | 13.37%     | 18,821,793.57 | 86.63%     |

### 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 | 16,853.78 | 0.0776%  |

### 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的情况

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

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016年12月21日）基金份额总额 | 348,189,279.94 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 29,752,771.85  |
| 本报告期基金总申购份额                | 2,337,934.17   |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 10,364,512.45  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）   | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 21,726,193.57  |

## § 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 2021 年 1 月 21 日起,刘小舫女士担任公司督察长职务,高宇先生不再代任公司督察长职务。具体详情参见 2021 年 1 月 22 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站(www.ftfund.com)上的《泰信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。本公司上述人事变动已按相关规定进行备案。

2、中国工商银行股份有限公司(以下简称“本公司”)根据工作需要,任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理,全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易         |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|--------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额         | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 广发证券 | 2      | 8,560,486.07 | 47.58%       | 7,801.28  | 51.58%     | -  |
| 东方证券 | 1      | 3,863,449.85 | 21.47%       | 2,825.24  | 18.68%     | -  |
| 天风证券 | 1      | 3,403,626.12 | 18.92%       | 2,489.02  | 16.46%     | -  |
| 华泰证券 | 1      | 1,800,595.00 | 10.01%       | 1,676.84  | 11.09%     | -  |
| 浙商证券 | 1      | 364,483.00   | 2.03%        | 332.16    | 2.20%      | -  |

|        |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 川财证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 开源证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源   | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际   | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 广州证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国融证券   | 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，对席位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、本报告期内本基金新增交易单元：财通证券深圳 011442、恒泰证券深圳 399146、德邦证券深圳 012749；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 |
|--------|------------|--------------|------|----------------|------|--------------|
| 广发证券   | 690,651.50 | 100.00%      | -    | -              | -    | -            |
| 东方证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 天风证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 华泰证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 浙商证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 川财证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 中泰证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 东方财富证券 | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 开源证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 新时代证券  | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 恒泰证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 国盛证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 民生证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 财通证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 国信证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 渤海证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 光大证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 东兴证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 申万宏源   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 华创证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 德邦证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 中银国际   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 西部证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 广州证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 东北证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 中国银河证券 | -          | -            | -    | -              | -    | -            |
| 国融证券   | -          | -            | -    | -              | -    | -            |

## 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  | 参加国金证券申购费率优惠 | 《证券时报》及规定网站 | 2021年1月19日 |
| 2  | 2020年4季度报告   | 《证券时报》及规定网站 | 2021年1月21日 |

|    |   |             |                 |
|----|---|-------------|-----------------|
| 3  | 基金行业高级管理人员变更公告                                    | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 4  | 终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司和大泰金石基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务    | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 1 月 27 日 |
| 5  | 招募说明书更新、产品资料概要更新                                  | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 3 月 12 日 |
| 6  | 新增北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构并开通定投、转换业务及参加费率优惠活动的公告         | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 3 月 25 日 |
| 7  | 参与盈米基金转换费率优惠活动的公告                                 | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 3 月 25 日 |
| 8  | 2020 年年度报告  | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 3 月 29 日 |
| 9  | 新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并开通转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告         | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 4 月 1 日  |
| 10 | 新增甬兴证券有限公司为销售机构并开通定投、转换业务及参加其费率优惠活动的公告            | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 4 月 1 日  |
| 11 | 新增中国中金财富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》及规定网站 | 2021 年 4 月 1 日  |
| 12 | 在济安财富、同花顺基金、天天基金、挖财基金、和耕传承的申购和赎回限额进行调整            | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 4 月 8 日  |
| 13 | 2021 年 1 季度报告                                     | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 4 月 20 日 |
| 14 | 参与宁波银行股份有限公司同业基金销售平台的销售业务并开通转换、定投业务及参加申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》及规定网站 | 2021 年 5 月 26 日 |



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|--|----------------|-------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构   | -              | -                       | -             | -    | -    | -             | -      |
| 个人   | 1              | 20210101 - 20210630     | 10,010,700.00 | 0.00 | 0.00 | 10,010,700.00 | 46.08% |
| 产品特有风险   |                |                         |               |      |      |               |        |
| <p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p> |                |                         |               |      |      |               |        |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信智选成长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。

### 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](http://www.ftfund.com))查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988, 021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2021年8月28日