

泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资 基金（LOF）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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
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.....	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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
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
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 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.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	泰信基本面 400
场内简称	泰信 400
基金主代码	162907
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2020 年 11 月 24 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,256,972.40 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	暂未上市

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

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪。力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以分享中国经济的长期增长的成果，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证锐联基本面 400 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	95%×中证锐联基本面 400 指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 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	http://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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	3,992,417.13
本期利润	1,828,161.51
加权平均基金份额本期利润	0.0546
本期加权平均净值利润率	4.65%
本期基金份额净值增长率	6.29%
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	11,011,316.25
期末可供分配基金份额利润	0.5718
期末基金资产净值	23,661,521.04
期末基金份额净值	1.2287
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	3.60%

注：1、本基金基金合同于2012年9月7日正式生效。于2020年11月24日变更为泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金（LOF）。

2、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

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	-0.21%	0.64%	-0.61%	0.63%	0.40%	0.01%
过去三个月	7.07%	0.71%	4.98%	0.66%	2.09%	0.05%
过去六个月	6.29%	1.04%	4.35%	1.02%	1.94%	0.02%
自基金合同生效起至今	3.60%	1.03%	1.89%	1.02%	1.71%	0.01%

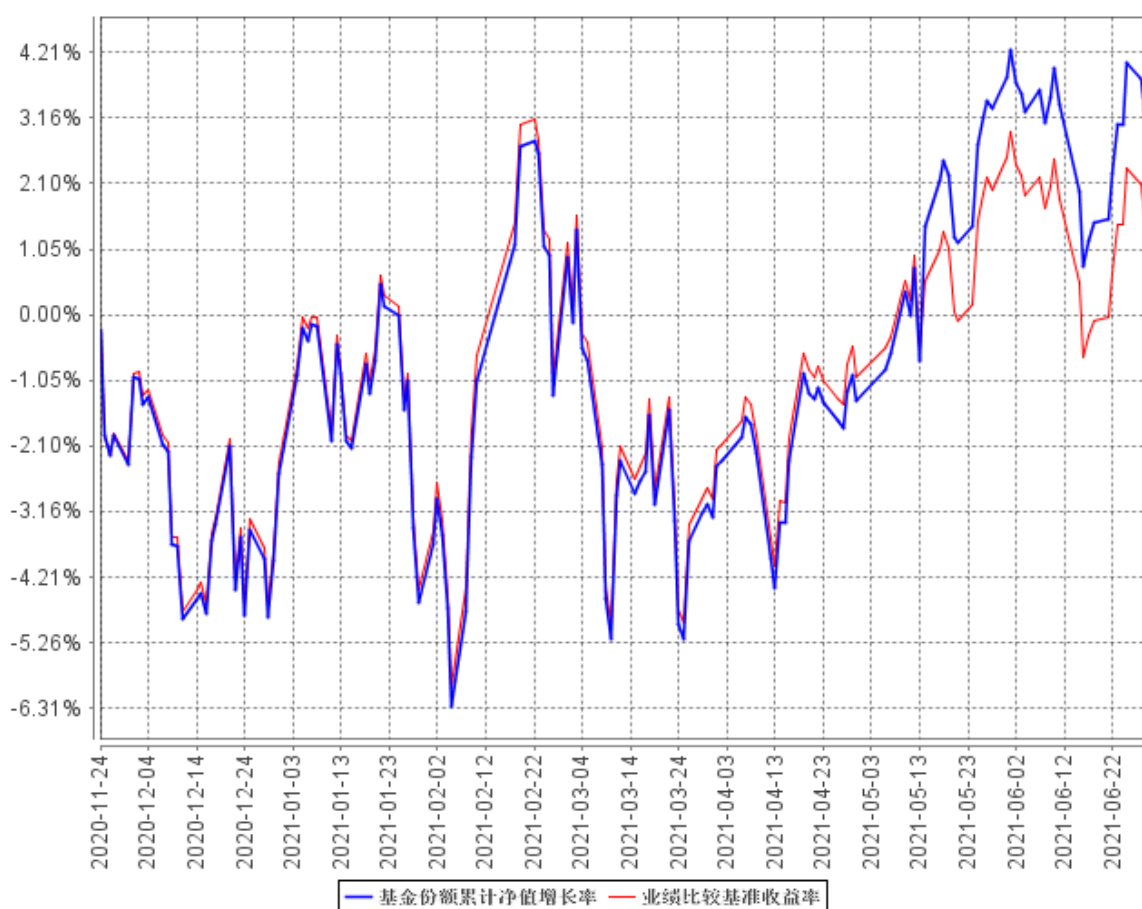
注：本基金业绩比较基准为：95%×中证锐联基本面400指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）

中证锐联基本面 400 指数以沪深 A 股为样本空间，挑选基本面价值中间的第 201 家至第 600 家上市公司作为样本股，基本面价值由四个财务指标来衡量：营业收入、现金流、净资产和分红；样本股的权重配置由基本面价值决定，在一定程度上打破了样本市值与其权重之间的关联，避免了传统市值指数中过多配置高估股票的现象。

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

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

§ 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		
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	2015 年 1 月 6 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、任职日期是指公司公告日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

上半年，沪综指涨幅 5.18%，深证成指涨幅 6.76%，创业板指数涨幅 19.88%。上半年指数分化明显，而行业和个股分化更为显著。

报告期内，本基金作为被动操作的指数基金，严格执行基金合同规定的投资策略，按照规定的投资策略和方法进行投资操作，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，报告期内跟踪误差控制在 1.71%。报告期跟踪误差主要是由于基金申购赎回和标的指数成分股定期调整等因素所造成。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2287 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.29%，业绩比较基准收益率为 4.35%。

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，海外不确定因素依旧存在。本次疫情对全球经济冲击剧烈，类比一次经济危机，而美联储政策响应迅速、力度空前，未来仍将维持较长时间低利率环境，有利于新兴股票市场表现。

国内率先控制住疫情，在常态化防控的政策思路下，国内经济生产继续复苏。展望下半年，国内第三波德尔塔变异毒株疫情已被控制，零星出现的地区疫情也都被及时扑灭。海外随着新冠疫苗注射覆盖范围逐步扩大，德尔塔变异毒株造成的重症和死亡率比不注射疫苗的情况降低很多，欧美部分国家认为基本控制住新冠疫情，可以全面开放。新冠疫苗正在全球范围接种，全球经济正在复苏中，大宗商品全面涨价。

如果疫情防控见效，美国的货币和财政政策可能会平稳转向，我们需要关注美国通胀预期上行带来的全球紧缩预期。中国资本市场对外开放的步伐不断加快，A 股国际化背景下海外资金不断流入。同时资本市场各项改革加速推进等均利好 A 股。

本基金作为一只投资于中证锐联基本面 400 指数的被动指数基金产品，我们将坚持指数化投资理念，控制基金跟踪误差，通过模拟指数，跟踪市场趋势，使本产品成为投资者良好的资产配置工具。本基金将继续规范运作，审慎投资，勤勉尽责地维护基金份额持有人利益。

4.6 管理人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

本基金收益分配应遵循下列原则：

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

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

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

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）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中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）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：泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,746,180.03	2,630,466.35
结算备付金		-	-
存出保证金		4,570.94	2,137.78
交易性金融资产	6.4.7.2	22,009,181.80	42,509,856.10
其中：股票投资		22,009,181.80	42,509,856.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	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	153.86	252.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		23,760,086.63	45,142,712.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	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		-	44,864.35
应付管理人报酬		19,335.64	37,926.37
应付托管费		4,253.82	8,343.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	26,829.02	1,171.35
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	48,147.11	91,275.36
负债合计		98,565.59	183,581.23
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	12,650,204.79	25,548,318.82
未分配利润	6.4.7.10	11,011,316.25	19,410,812.29
所有者权益合计		23,661,521.04	44,959,131.11
负债和所有者权益总计		23,760,086.63	45,142,712.34

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2287 元，基金份额总额 19,256,972.40 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：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	
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
一、收入			2,194,630.88
1.利息收入			4,156.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11		4,156.17
债券利息收入			-
资产支持证券利息收入			-
买入返售金融资产收入			-
证券出借利息收入			-
其他利息收入			-
2.投资收益（损失以“-”填列）			4,354,190.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12		4,089,590.29
基金投资收益			-
债券投资收益	6.4.7.13		-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1		-
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		264,599.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17		-2,164,255.62
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		540.29
减：二、费用			366,469.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1		196,306.47
2. 托管费	6.4.10.2.2		43,187.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3		-

4. 交易费用	6.4.7.19	58,441.31
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	68,534.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,828,161.51
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,828,161.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	25,548,318.82	19,410,812.29	44,959,131.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,828,161.51	1,828,161.51
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）	-12,898,114.03	-10,227,657.55	-23,125,771.58
其中：1.基金申购款	241,775.33	188,363.01	430,138.34
2.基金赎回款	-13,139,889.36	-10,416,020.56	-23,555,909.92
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）	12,650,204.79	11,011,316.25	23,661,521.04

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>高宇</u>	<u>叶振宇</u>	<u>叶振宇</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

泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 252 号《关于核准泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金募集的批复》核准,由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约开放式,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 300,797,873.45 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 346 号验资报告予以验证。原基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。自 2020 年 11 月 24 日起,本基金由泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(LOF)。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金实施转型的公告》,2020 年 9 月 15 日至 2020 年 10 月 20 日期间管理人召开了以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会,审议通过了《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。自 2020 年 11 月 24 日起,《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(LOF)托管协议》将生效,原《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金托管协议》将自同一起失效。泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金正式变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(LOF)。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的其他股票)、债券(含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券等)、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。其中，中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购等其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的标的指数是中证锐联基本面 400 指数。本基金的业绩比较基准是 $95\% \times$ 中证锐联基本面 400 指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行人民币活期存款利率(税后)。

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 年度上半年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
	2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,746,180.03
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：	1,746,180.03

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		
	2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,921,631.52	22,009,181.80	1,087,550.28
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	20,921,631.52	22,009,181.80	1,087,550.28

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

本基金本报告期末无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 2021年6月30日
应收活期存款利息	151.97
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1.89
合计	153.86

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	26,829.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	26,829.02

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	39,671.58
应付指数使用费	8,475.53
合计	48,147.11

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,891,838.26	25,548,318.82
本期申购	368,050.38	241,775.33
本期赎回(以“-”号填列)	-20,002,916.24	-13,139,889.36
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	19,256,972.40	12,650,204.79

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	14,228,593.86	5,182,218.43	19,410,812.29
本期利润	3,992,417.13	-2,164,255.62	1,828,161.51
本期基金份额交易产生的变动数	-7,056,968.40	-3,170,689.15	-10,227,657.55
其中：基金申购款	140,208.32	48,154.69	188,363.01
基金赎回款	-7,197,176.72	-3,218,843.84	-10,416,020.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,164,042.59	-152,726.34	11,011,316.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,144.01
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	-
其他	12.16
合计	4,156.17

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	28,399,535.74
减：卖出股票成本总额	24,309,945.45
买卖股票差价收入	4,089,590.29

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	264,599.75
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	264,599.75
----	------------

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,164,255.62
——股票投资	-2,164,255.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-2,164,255.62

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	540.29
合计	540.29

注：本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。本基金对于持续持有期大于等于 7 日的投资者，场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，本基金收取的赎回费中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

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	58,441.31
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	58,441.31

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	14,876.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
债券账户维护费——中债登	4,500.00
银行划款手续费	232.00
债券账户维护费——上清所	4,500.00
指数使用费	19,630.62
合计	68,534.20

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

截至本报告期末，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

本报告期无需要说明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

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 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	196,306.47
其中：支付销售机构的客户维护费	8,817.73

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	43,187.39

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期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

本报告期本基金与关联方未发生银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
报告期初持有的基金份额	15,710,482.63
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	15,710,482.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	81.58%

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额 的比例
山东省国际信托股份有限 公司	0.00	0.00%	19,415,951.10	49.92%

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

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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,746,180.03	4,144.01

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

本基金本报告期内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（2021年6月30日）本基金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。

6.4.12.1 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 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
600811	东方 集团	2021 年6 月30	重大 事项	3.05	2021 年7 月14	3.36	18,674	81,978.31	56,955.70	-

		日			日					
600093	易见股份	2021年5月6日	重大事项	5.93	2021年7月7日	5.63	5,559	61,955.89	32,964.87	-

6.4.12.2 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。

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

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（于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券）。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 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 0.3800%。

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 23,665,441.26 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款。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 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,746,180.03	-	-	-	1,746,180.03
存出保证金	4,570.94	-	-	-	4,570.94

交易性金融资产	-	-	-	22,009,181.80	22,009,181.80
应收利息	-	-	-	153.86	153.86
资产总计	1,750,750.97	-	-	22,009,335.66	23,760,086.63
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	19,335.64	19,335.64
应付托管费	-	-	-	4,253.82	4,253.82
应付交易费用	-	-	-	26,829.02	26,829.02
其他负债	-	-	-	48,147.11	48,147.11
负债总计	-	-	-	98,565.59	98,565.59
利率敏感度缺口	1,750,750.97	-	-	21,910,770.07	23,661,521.04
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,630,466.35	-	-	-	2,630,466.35
存出保证金	2,137.78	-	-	-	2,137.78
交易性金融资产	-	-	-	42,509,856.10	42,509,856.10
应收利息	-	-	-	252.11	252.11
资产总计	2,632,604.13	-	-	42,510,108.21	45,142,712.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	44,864.35	44,864.35
应付管理人报酬	-	-	-	37,926.37	37,926.37
应付托管费	-	-	-	8,343.80	8,343.80
应付交易费用	-	-	-	1,171.35	1,171.35
其他负债	-	-	-	91,275.36	91,275.36
负债总计	-	-	-	183,581.23	183,581.23
利率敏感度缺口	2,632,604.13	-	-	42,326,526.98	44,959,131.11

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	22,009,181.80	93.02	42,509,856.10	94.55
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	22,009,181.80	93.02	42,509,856.10	94.55

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（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%	778,112.12	2,255,437.53
2. 业绩比较基准下降 5%	-778,112.12	-2,255,437.53	

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	22,009,181.80	92.63
	其中：股票	22,009,181.80	92.63
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	1,746,180.03	7.35
8	其他各项资产	4,724.80	0.02
9	合计	23,760,086.63	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	121,891.68	0.52
B	采矿业	1,077,623.04	4.55
C	制造业	12,345,579.77	52.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	761,866.59	3.22
E	建筑业	520,155.59	2.20
F	批发和零售业	1,516,235.02	6.41
G	交通运输、仓储和邮政业	763,327.47	3.23
H	住宿和餐饮业	35,138.15	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	772,859.63	3.27
J	金融业	2,119,617.15	8.96
K	房地产业	1,082,676.61	4.58
L	租赁和商务服务业	317,599.35	1.34
M	科学研究和技术服务业	94,267.18	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	182,307.81	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	21,328.69	0.09
Q	卫生和社会工作	51,105.60	0.22
R	文化、体育和娱乐业	225,602.47	0.95
S	综合	-	-
	合计	22,009,181.80	93.02

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	占基金资产净值比例（%）
1	600325	华发股份	24,298	163,768.52	0.69
2	601377	兴业证券	16,200	156,492.00	0.66
3	601233	桐昆股份	6,402	154,224.18	0.65
4	000034	神州数码	6,468	141,325.80	0.60
5	000039	中集集团	7,458	135,586.44	0.57
6	002241	歌尔股份	3,144	134,374.56	0.57
7	600699	均胜电子	5,201	132,729.52	0.56
8	600522	中天科技	13,191	131,910.00	0.56
9	600418	江淮汽车	10,558	131,235.94	0.55
10	600271	航天信息	9,800	127,694.00	0.54
11	600703	三安光电	3,800	121,790.00	0.51
12	000401	冀东水泥	9,795	120,968.25	0.51
13	300226	上海钢联	2,026	120,648.30	0.51
14	600637	东方明珠	13,900	113,841.00	0.48
15	600060	海信视像	6,705	113,314.50	0.48
16	600500	中化国际	14,300	112,398.00	0.48
17	600348	华阳股份	14,826	110,008.92	0.46
18	600332	白云山	3,200	108,320.00	0.46
19	002183	怡亚通	18,014	103,220.22	0.44
20	000059	华锦股份	12,519	102,155.04	0.43
21	601555	东吴证券	11,933	99,521.22	0.42
22	000983	山西焦煤	11,934	99,171.54	0.42
23	000728	国元证券	12,402	98,843.94	0.42
24	000938	紫光股份	4,480	98,022.40	0.41
25	000830	鲁西化工	5,091	95,354.43	0.40

26	601128	常熟银行	15,379	95,349.80	0.40
27	000783	长江证券	12,900	94,428.00	0.40
28	603259	药明康德	602	94,267.18	0.40
29	002129	中环股份	2,433	93,913.80	0.40
30	600873	梅花生物	16,648	93,228.80	0.39
31	002001	新和成	3,235	92,779.80	0.39
32	600166	福田汽车	26,752	92,294.40	0.39
33	002456	欧菲光	10,351	91,916.88	0.39
34	000878	云南铜业	7,123	91,388.09	0.39
35	600390	五矿资本	15,270	91,314.60	0.39
36	600143	金发科技	4,366	91,074.76	0.38
37	300059	东方财富	2,763	90,598.77	0.38
38	600176	中国巨石	5,828	90,392.28	0.38
39	002311	海大集团	1,105	90,168.00	0.38
40	000413	东旭光电	43,200	89,856.00	0.38
41	600710	苏美达	14,423	89,134.14	0.38
42	600100	同方股份	14,463	88,368.93	0.37
43	000963	华东医药	1,915	88,109.15	0.37
44	002299	圣农发展	3,676	87,782.88	0.37
45	600502	安徽建工	21,945	85,146.60	0.36
46	603858	步长制药	3,770	84,787.30	0.36
47	002236	大华股份	3,994	84,273.40	0.36
48	000050	深天马 A	5,870	83,236.60	0.35
49	600584	长电科技	2,188	82,443.84	0.35
50	002385	大北农	12,007	81,647.60	0.35
51	600466	蓝光发展	27,611	81,452.45	0.34
52	600487	亨通光电	7,129	81,270.60	0.34
53	000977	浪潮信息	2,885	81,155.05	0.34
54	600567	山鹰国际	23,409	80,761.05	0.34
55	600208	新湖中宝	26,528	80,645.12	0.34
56	002422	科伦药业	4,037	80,538.15	0.34
57	601333	广深铁路	37,872	80,288.64	0.34
58	600426	华鲁恒升	2,588	80,098.60	0.34
59	002384	东山精密	3,834	79,900.56	0.34
60	600739	辽宁成大	3,834	79,785.54	0.34
61	300760	迈瑞医疗	166	79,688.30	0.34
62	600507	方大特钢	11,700	79,326.00	0.34
63	600266	城建发展	16,669	79,011.06	0.33
64	600008	首创环保	26,245	78,997.45	0.33

65	600535	天士力	5,316	78,729.96	0.33
66	600528	中铁工业	9,688	78,472.80	0.33
67	600516	方大炭素	10,504	78,149.76	0.33
68	000623	吉林敖东	5,016	77,697.84	0.33
69	002221	东华能源	7,041	77,098.95	0.33
70	002081	金螳螂	9,690	76,744.80	0.32
71	002416	爱施德	7,632	76,548.96	0.32
72	000960	锡业股份	4,760	76,302.80	0.32
73	002078	太阳纸业	5,704	76,148.40	0.32
74	000488	晨鸣纸业	9,305	75,742.70	0.32
75	002271	东方雨虹	1,365	75,511.80	0.32
76	300070	碧水源	10,294	75,249.14	0.32
77	000581	威孚高科	3,605	75,092.15	0.32
78	002004	华邦健康	12,063	74,911.23	0.32
79	002048	宁波华翔	3,837	74,821.50	0.32
80	002091	江苏国泰	8,211	74,720.10	0.32
81	601699	潞安环能	6,283	74,202.23	0.31
82	600801	华新水泥	4,201	73,811.57	0.31
83	600827	百联股份	3,617	72,882.55	0.31
84	600893	航发动力	1,357	72,178.83	0.31
85	601108	财通证券	6,848	71,835.52	0.30
86	601636	旗滨集团	3,870	71,827.20	0.30
87	000060	中金岭南	15,825	71,529.00	0.30
88	002157	正邦科技	5,978	71,437.10	0.30
89	601168	西部矿业	5,978	71,317.54	0.30
90	601216	君正集团	13,993	71,224.37	0.30
91	600409	三友化工	7,020	70,972.20	0.30
92	002131	利欧股份	30,300	70,902.00	0.30
93	600109	国金证券	5,559	70,543.71	0.30
94	603156	养元饮品	2,448	69,963.84	0.30
95	300118	东方日升	3,600	69,840.00	0.30
96	600061	国投资本	8,220	69,787.80	0.29
97	601866	中远海发	18,542	69,532.50	0.29
98	600745	闻泰科技	717	69,477.30	0.29
99	002340	格林美	7,411	69,292.85	0.29
100	600126	杭钢股份	13,488	69,193.44	0.29
101	300274	阳光电源	600	69,036.00	0.29
102	002233	塔牌集团	6,628	68,135.84	0.29
103	600498	烽火通信	3,648	67,962.24	0.29

104	002958	青农商行	15,799	67,619.72	0.29
105	000786	北新建材	1,713	67,235.25	0.28
106	600694	大商股份	3,190	66,224.40	0.28
107	000540	中天金融	23,998	65,514.54	0.28
108	601666	平煤股份	9,181	65,276.91	0.28
109	300124	汇川技术	879	65,274.54	0.28
110	600256	广汇能源	19,580	65,201.40	0.28
111	601872	招商轮船	14,051	64,915.62	0.27
112	000690	宝新能源	12,697	64,881.67	0.27
113	600056	中国医药	5,332	64,783.80	0.27
114	000627	天茂集团	17,821	64,512.02	0.27
115	600511	国药股份	1,944	64,268.64	0.27
116	000036	华联控股	13,781	64,219.46	0.27
117	600096	云天化	4,560	64,022.40	0.27
118	601901	方正证券	6,815	63,788.40	0.27
119	000829	天音控股	7,738	63,761.12	0.27
120	000016	深康佳 A	9,494	63,230.04	0.27
121	000768	中航西飞	2,406	63,229.68	0.27
122	601718	际华集团	22,416	63,213.12	0.27
123	600380	健康元	4,573	62,787.29	0.27
124	600711	盛屯矿业	8,806	62,786.78	0.27
125	002008	大族激光	1,548	62,523.72	0.26
126	002075	沙钢股份	5,730	62,514.30	0.26
127	600970	中材国际	6,790	62,264.30	0.26
128	601000	唐山港	25,810	62,202.10	0.26
129	600307	酒钢宏兴	26,752	62,064.64	0.26
130	600583	海油工程	13,691	61,609.50	0.26
131	002938	鹏鼎控股	1,714	61,498.32	0.26
132	600183	生益科技	2,610	61,100.10	0.26
133	000090	天健集团	11,030	60,995.90	0.26
134	600085	同仁堂	1,491	60,907.35	0.26
135	002085	万丰奥威	10,798	60,468.80	0.26
136	002966	苏州银行	8,211	60,350.85	0.26
137	600021	上海电力	8,700	60,117.00	0.25
138	002230	科大讯飞	883	59,673.14	0.25
139	000423	东阿阿胶	1,661	59,646.51	0.25
140	601717	郑煤机	5,105	59,371.15	0.25
141	300058	蓝色光标	9,802	59,302.10	0.25
142	603799	华友钴业	519	59,269.80	0.25

143	600875	东方电气	5,393	59,161.21	0.25
144	600497	驰宏锌锗	13,723	59,146.13	0.25
145	002050	三花智控	2,464	59,086.72	0.25
146	600742	一汽富维	5,796	59,061.24	0.25
147	002244	滨江集团	14,052	58,877.88	0.25
148	600489	中金黄金	6,810	58,702.20	0.25
149	600663	陆家嘴	4,400	58,608.00	0.25
150	002128	露天煤业	5,612	58,420.92	0.25
151	002203	海亮股份	5,488	58,392.32	0.25
152	600667	太极实业	6,395	58,194.50	0.25
153	002589	瑞康医药	13,119	58,117.17	0.25
154	600578	京能电力	19,400	57,812.00	0.24
155	600150	中国船舶	3,478	57,421.78	0.24
156	600004	白云机场	5,127	57,319.86	0.24
157	600908	无锡银行	9,849	57,124.20	0.24
158	600565	迪马股份	22,488	57,119.52	0.24
159	600811	东方集团	18,674	56,955.70	0.24
160	600233	圆通速递	5,680	56,856.80	0.24
161	600079	人福医药	1,995	56,398.65	0.24
162	002555	三七互娱	2,346	56,350.92	0.24
163	000883	湖北能源	12,200	55,998.00	0.24
164	002120	韵达股份	4,113	55,648.89	0.24
165	600879	航天电子	7,384	55,527.68	0.23
166	600373	中文传媒	5,629	55,501.94	0.23
167	000528	柳工	6,756	55,399.20	0.23
168	601995	中金公司	900	55,350.00	0.23
169	600273	嘉化能源	6,333	55,097.10	0.23
170	600729	重庆百货	1,989	54,598.05	0.23
171	601098	中南传媒	6,165	54,375.30	0.23
172	603589	口子窖	795	53,813.55	0.23
173	600064	南京高科	5,789	53,779.81	0.23
174	000513	丽珠集团	1,074	53,721.48	0.23
175	000591	太阳能	8,564	53,353.72	0.23
176	601611	中国核建	7,359	53,131.98	0.22
177	601058	赛轮轮胎	5,287	52,817.13	0.22
178	002440	闰土股份	5,966	52,799.10	0.22
179	002701	奥瑞金	10,257	52,720.98	0.22
180	601198	东兴证券	4,808	52,551.44	0.22
181	600863	内蒙华电	22,527	52,487.91	0.22

182	600037	歌华有线	5,449	52,364.89	0.22
183	000027	深圳能源	5,700	52,269.00	0.22
184	000028	国药一致	1,379	52,181.36	0.22
185	000078	海王生物	15,997	52,150.22	0.22
186	300003	乐普医疗	1,623	52,130.76	0.22
187	002602	世纪华通	8,088	51,924.96	0.22
188	000717	韶钢松山	11,304	51,885.36	0.22
189	600884	杉杉股份	2,216	51,677.12	0.22
190	000066	中国长城	3,529	51,523.40	0.22
191	000887	中鼎股份	4,260	51,460.80	0.22
192	300015	爱尔眼科	720	51,105.60	0.22
193	002408	齐翔腾达	4,101	50,934.42	0.22
194	600369	西南证券	10,451	50,896.37	0.22
195	600546	山煤国际	7,080	50,834.40	0.21
196	000543	皖能电力	13,406	50,808.74	0.21
197	000750	国海证券	11,946	50,651.04	0.21
198	300207	欣旺达	1,552	50,533.12	0.21
199	600600	青岛啤酒	435	50,307.75	0.21
200	600582	天地科技	12,877	50,220.30	0.21
201	600885	宏发股份	800	50,160.00	0.21
202	000921	海信家电	3,486	50,093.82	0.21
203	600026	中远海能	8,115	49,988.40	0.21
204	600491	龙元建设	9,282	49,937.16	0.21
205	300677	英科医疗	400	49,920.00	0.21
206	600973	宝胜股份	12,097	49,839.64	0.21
207	002508	老板电器	1,071	49,801.50	0.21
208	601360	三六零	4,075	49,755.75	0.21
209	002624	完美世界	2,062	49,302.42	0.21
210	000686	东北证券	5,787	48,900.15	0.21
211	600859	王府井	1,693	48,893.84	0.21
212	603225	新风鸣	2,400	48,720.00	0.21
213	600664	哈药股份	16,819	48,606.91	0.21
214	600094	大名城	12,860	48,482.20	0.20
215	600308	华泰股份	8,726	48,167.52	0.20
216	300408	三环集团	1,135	48,146.70	0.20
217	600549	厦门钨业	2,310	48,117.30	0.20
218	601212	白银有色	18,417	48,068.37	0.20
219	000807	云铝股份	4,035	48,016.50	0.20
220	000789	万年青	4,184	47,864.96	0.20

221	600039	四川路桥	7,585	47,557.95	0.20
222	000501	鄂武商 A	4,043	47,303.10	0.20
223	600141	兴发集团	2,512	47,300.96	0.20
224	002926	华西证券	4,907	47,254.41	0.20
225	601567	三星医疗	2,214	47,158.20	0.20
226	600482	中国动力	2,706	47,138.52	0.20
227	600320	振华重工	13,900	47,121.00	0.20
228	002563	森马服饰	3,939	47,071.05	0.20
229	000723	美锦能源	6,185	46,758.60	0.20
230	002010	传化智联	6,061	46,730.31	0.20
231	600277	亿利洁能	13,845	46,657.65	0.20
232	601179	中国西电	11,295	46,535.40	0.20
233	002080	中材科技	1,766	46,216.22	0.20
234	600058	五矿发展	5,859	46,168.92	0.20
235	002310	东方园林	13,500	46,035.00	0.19
236	601966	玲珑轮胎	1,052	46,014.48	0.19
237	000600	建投能源	9,363	45,972.33	0.19
238	002572	索菲亚	1,898	45,931.60	0.19
239	000718	苏宁环球	5,500	45,595.00	0.19
240	600720	祁连山	4,300	45,322.00	0.19
241	000685	中山公用	5,500	44,880.00	0.19
242	600436	片仔癀	100	44,830.00	0.19
243	600216	浙江医药	2,800	44,828.00	0.19
244	002936	郑州银行	12,186	44,722.62	0.19
245	000877	天山股份	3,425	44,627.75	0.19
246	002061	浙江交科	8,398	44,509.40	0.19
247	600623	华谊集团	5,049	44,481.69	0.19
248	000031	大悦城	12,333	44,398.80	0.19
249	601231	环旭电子	2,631	44,227.11	0.19
250	600787	中储股份	8,297	44,223.01	0.19
251	600415	小商品城	8,579	44,181.85	0.19
252	002500	山西证券	6,521	43,755.91	0.18
253	600737	中粮糖业	4,352	43,563.52	0.18
254	600160	巨化股份	4,887	43,201.08	0.18
255	600569	安阳钢铁	14,094	43,127.64	0.18
256	600597	光明乳业	2,982	42,970.62	0.18
257	600073	上海梅林	5,240	42,915.60	0.18
258	002007	华兰生物	1,165	42,732.20	0.18
259	300122	智飞生物	228	42,574.44	0.18

260	000999	华润三九	1,590	42,532.50	0.18
261	600997	开滦股份	5,665	42,487.50	0.18
262	600335	国机汽车	7,157	42,441.01	0.18
263	688036	传音控股	200	41,900.00	0.18
264	002191	劲嘉股份	3,935	41,868.40	0.18
265	000598	兴蓉环境	7,991	41,633.11	0.18
266	600580	卧龙电驱	3,115	41,429.50	0.18
267	600809	山西汾酒	92	41,216.00	0.17
268	000021	深科技	2,152	41,189.28	0.17
269	002065	东华软件	5,156	40,887.08	0.17
270	000937	冀中能源	10,400	40,872.00	0.17
271	603766	隆鑫通用	11,222	40,735.86	0.17
272	600312	平高电气	6,919	40,406.96	0.17
273	603195	公牛集团	200	40,400.00	0.17
274	000951	中国重汽	1,485	40,184.10	0.17
275	601886	江河集团	4,625	39,867.50	0.17
276	000661	长春高新	103	39,861.00	0.17
277	000826	启迪环境	7,405	39,616.75	0.17
278	002042	华孚时尚	8,198	39,596.34	0.17
279	002217	合力泰	11,006	39,291.42	0.17
280	600835	上海机电	2,416	39,260.00	0.17
281	300146	汤臣倍健	1,190	39,151.00	0.17
282	600123	兰花科创	5,056	39,133.44	0.17
283	600909	华安证券	7,001	38,995.57	0.16
284	600120	浙江东方	9,101	38,952.28	0.16
285	300072	三聚环保	6,762	38,813.88	0.16
286	000975	银泰黄金	4,063	38,639.13	0.16
287	600612	老凤祥	728	38,562.16	0.16
288	002419	天虹股份	5,873	38,526.88	0.16
289	002152	广电运通	2,946	38,386.38	0.16
290	002468	申通快递	5,034	38,359.08	0.16
291	002673	西部证券	4,646	38,329.50	0.16
292	600111	北方稀土	1,847	38,232.90	0.16
293	600971	恒源煤电	5,735	38,137.75	0.16
294	600657	信达地产	10,900	37,932.00	0.16
295	000550	江铃汽车	1,610	37,722.30	0.16
296	600643	爱建集团	5,400	37,692.00	0.16
297	600959	江苏有线	12,341	37,640.05	0.16
298	000559	万向钱潮	7,032	37,339.92	0.16

299	601615	明阳智能	2,300	37,237.00	0.16
300	002745	木林森	2,776	37,198.40	0.16
301	002251	步步高	5,051	37,175.36	0.16
302	603806	福斯特	353	37,110.89	0.16
303	002841	视源股份	297	36,914.13	0.16
304	002252	上海莱士	4,900	36,701.00	0.16
305	002237	恒邦股份	3,181	36,549.69	0.15
306	600682	南京新百	3,633	36,547.98	0.15
307	600298	安琪酵母	668	36,325.84	0.15
308	002013	中航机电	3,604	36,292.28	0.15
309	600977	中国电影	2,892	36,236.76	0.15
310	000537	广宇发展	6,895	36,060.85	0.15
311	002558	巨人网络	2,700	35,910.00	0.15
312	600928	西安银行	7,697	35,868.02	0.15
313	002294	信立泰	1,087	35,762.30	0.15
314	000301	东方盛虹	1,700	35,530.00	0.15
315	600754	锦江酒店	617	35,138.15	0.15
316	002242	九阳股份	1,068	34,699.32	0.15
317	603816	顾家家居	449	34,698.72	0.15
318	600038	中直股份	654	34,491.96	0.15
319	601878	浙商证券	2,610	34,138.80	0.14
320	600598	北大荒	2,280	34,108.80	0.14
321	000933	神火股份	3,586	33,887.70	0.14
322	600691	阳煤化工	9,891	33,827.22	0.14
323	600588	用友网络	1,012	33,659.12	0.14
324	601860	紫金银行	9,241	33,544.83	0.14
325	000902	新洋丰	2,131	33,307.53	0.14
326	601928	凤凰传媒	4,660	33,272.40	0.14
327	600062	华润双鹤	2,784	33,157.44	0.14
328	000732	泰禾集团	15,300	33,048.00	0.14
329	603369	今世缘	610	33,037.60	0.14
330	600093	易见股份	5,559	32,964.87	0.14
331	000987	越秀金控	2,596	32,865.36	0.14
332	000990	诚志股份	2,580	32,843.40	0.14
333	601021	春秋航空	566	32,205.40	0.14
334	600901	江苏租赁	6,173	32,099.60	0.14
335	600483	福能股份	3,055	32,046.95	0.14
336	000582	北部湾港	3,800	31,540.00	0.13
337	000950	重药控股	6,268	31,528.04	0.13

338	000672	上峰水泥	1,800	31,464.00	0.13
339	600566	济川药业	1,754	31,396.60	0.13
340	002648	卫星石化	800	31,352.00	0.13
341	000729	燕京啤酒	4,325	31,313.00	0.13
342	601001	晋控煤业	4,300	31,218.00	0.13
343	601828	美凯龙	2,600	31,200.00	0.13
344	603328	依顿电子	4,187	31,193.15	0.13
345	000800	一汽解放	2,822	30,534.04	0.13
346	000046	泛海控股	13,254	30,484.20	0.13
347	600420	国药现代	3,087	30,406.95	0.13
348	600748	上实发展	6,559	30,171.40	0.13
349	002831	裕同科技	991	29,422.79	0.12
350	600395	盘江股份	4,068	28,882.80	0.12
351	002372	伟星新材	1,393	28,793.31	0.12
352	603609	禾丰股份	2,697	28,102.74	0.12
353	002429	兆驰股份	4,600	27,922.00	0.12
354	600968	海油发展	10,539	27,296.01	0.12
355	002302	西部建设	3,444	27,207.60	0.11
356	002032	苏泊尔	418	26,664.22	0.11
357	300741	华宝股份	517	26,222.24	0.11
358	000828	东莞控股	2,200	26,202.00	0.11
359	601163	三角轮胎	1,790	25,990.80	0.11
360	603833	欧派家居	183	25,978.68	0.11
361	600648	外高桥	1,753	25,909.34	0.11
362	600803	新奥股份	1,569	25,904.19	0.11
363	600167	联美控股	2,900	25,897.00	0.11
364	600575	淮河能源	11,800	25,606.00	0.11
365	002948	青岛银行	5,146	25,575.62	0.11
366	000030	富奥股份	3,979	25,346.23	0.11
367	600760	中航沈飞	420	25,326.00	0.11
368	603899	晨光文具	295	24,945.20	0.11
369	600295	鄂尔多斯	1,389	24,849.21	0.11
370	601958	金钼股份	3,831	24,824.88	0.10
371	600231	凌钢股份	8,700	24,795.00	0.10
372	002939	长城证券	2,187	24,341.31	0.10
373	000156	华数传媒	3,117	24,032.07	0.10
374	600510	黑牡丹	3,600	24,012.00	0.10
375	603885	吉祥航空	1,568	23,927.68	0.10
376	002705	新宝股份	900	23,625.00	0.10

377	000596	古井贡酒	96	22,992.00	0.10
378	601298	青岛港	3,701	22,872.18	0.10
379	601808	中海油服	1,586	22,774.96	0.10
380	601801	皖新传媒	4,700	22,184.00	0.09
381	603866	桃李面包	700	21,840.00	0.09
382	300033	同花顺	193	21,766.54	0.09
383	603056	德邦股份	1,969	21,639.31	0.09
384	603260	合盛硅业	281	21,611.71	0.09
385	000967	盈峰环境	3,116	21,406.92	0.09
386	002607	中公教育	1,021	21,328.69	0.09
387	002064	华峰化学	1,500	21,300.00	0.09
388	603198	迎驾贡酒	471	20,865.30	0.09
389	002314	南山控股	6,000	19,980.00	0.08
390	601609	金田铜业	2,300	19,964.00	0.08
391	002459	晶澳科技	400	19,600.00	0.08
392	601139	深圳燃气	2,867	18,807.52	0.08
393	600299	安迪苏	1,508	18,035.68	0.08
394	000958	东方能源	3,477	15,264.03	0.06
395	600918	中泰证券	1,200	12,984.00	0.05
396	600517	国网英大	1,900	12,939.00	0.05
397	601686	友发集团	1,100	12,276.00	0.05
398	601568	北元集团	1,000	8,560.00	0.04
399	603868	飞科电器	200	8,412.00	0.04
400	601187	厦门银行	800	7,584.00	0.03
401	002532	天山铝业	700	5,873.00	0.02

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	601377	兴业证券	153,900.00	0.34
2	600271	航天信息	128,320.00	0.29
3	600637	东方明珠	116,773.77	0.26
4	600703	三安光电	107,426.00	0.24
5	600500	中化国际	103,246.00	0.23
6	600332	白云山	95,488.00	0.21

7	000783	长江证券	93,396.00	0.21
8	600507	方大特钢	84,474.00	0.19
9	000413	东旭光电	84,042.00	0.19
10	002311	海大集团	79,280.00	0.18
11	002131	利欧股份	70,902.00	0.16
12	601216	君正集团	70,347.00	0.16
13	000401	冀东水泥	64,500.00	0.14
14	600663	陆家嘴	60,951.00	0.14
15	600021	上海电力	59,856.00	0.13
16	000027	深圳能源	59,565.00	0.13
17	300274	阳光电源	58,656.00	0.13
18	000034	神州数码	58,610.00	0.13
19	600578	京能电力	58,394.00	0.13
20	000883	湖北能源	57,096.00	0.13

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	601012	隆基股份	693,810.55	1.54
2	600438	通威股份	464,922.75	1.03
3	000039	中集集团	358,620.30	0.80
4	000488	晨鸣纸业	332,519.81	0.74
5	000830	鲁西化工	301,709.04	0.67
6	600409	三友化工	270,503.43	0.60
7	000963	华东医药	263,841.37	0.59
8	601168	西部矿业	258,559.93	0.58
9	600166	福田汽车	244,188.78	0.54
10	601636	旗滨集团	237,578.10	0.53
11	600039	四川路桥	234,059.29	0.52
12	600426	华鲁恒升	227,906.69	0.51
13	000983	山西焦煤	224,085.42	0.50
14	600176	中国巨石	204,375.37	0.45
15	601058	赛轮轮胎	192,314.45	0.43
16	601233	桐昆股份	192,148.00	0.43
17	300059	东方财富	191,149.82	0.43

18	000933	神火股份	189,373.47	0.42
19	601699	潞安环能	188,334.76	0.42
20	000683	远兴能源	185,803.90	0.41

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	5,973,526.77
卖出股票收入（成交）总额	28,399,535.74

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有权证。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票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	4,570.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	153.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,724.80

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

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
633	30,421.76	15,713,574.63	81.60%	3,543,397.77	18.40%

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。

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（2020年11月24日）基金份额总额	39,447,859.47
本报告期期初基金份额总额	38,891,838.26
本报告期基金总申购份额	368,050.38
减：本报告期基金总赎回份额	20,002,916.24
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	19,256,972.40

§ 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	
东方证券	1	12,482,834.25	36.32%	9,128.60	33.82%	-
广发证券	2	10,094,493.94	29.37%	9,199.12	34.08%	-
开源证券	1	6,713,899.88	19.53%	4,910.03	18.19%	-
东方财富证券	1	4,892,763.44	14.23%	3,578.17	13.26%	-
华泰证券	1	189,071.00	0.55%	176.12	0.65%	-

川财证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	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	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	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，对交易单元租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本报告期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
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
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	修改基金合同、招募说明书、产品资料概要	《证券时报》及规定网站	2021 年 3 月 30 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	2021 年 1 季度报告	《证券时报》及规定网站	2021 年 4 月 20 日
12	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	1	20210101 - 20210513	19,415,951.10	0.00	19,415,951.10	0.00	0.00%
	2	20210101 - 20210630	15,710,482.63	0.00	0.00	15,710,482.63	81.58%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金设立，变更的文件
- 2、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 4、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）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住所（或办公场所）、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后，投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

12.3 查阅方式

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

泰信基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日