

泰信中证 200 指数证券投资基金 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.....	37
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.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证 200 指数证券投资基金
基金简称	泰信中证 200 指数
基金主代码	290010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 9 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,875,667.43 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，以实现对标的有效跟踪。力争控制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不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证 200 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 200 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	本基金业绩比较基准为：中证 200 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为指数型基金，具有较高风险和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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗丽娟	许俊
	联系电话	021-20899098	010-66594319
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-20899008	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号

	行大厦 36-37 层	
邮政编码	200120	100818
法定代表人	万众	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	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	9,712,297.59
本期利润	1,071,069.15
加权平均基金份额本期利润	0.0345
本期加权平均净值利润率	2.54%
本期基金份额净值增长率	5.98%
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	4,728,173.33
期末可供分配基金份额利润	0.4347
期末基金资产净值	15,603,840.76
期末基金份额净值	1.435
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	46.35%

注：1、本基金基金合同于 2011 年 6 月 9 日正式生效。

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

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

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

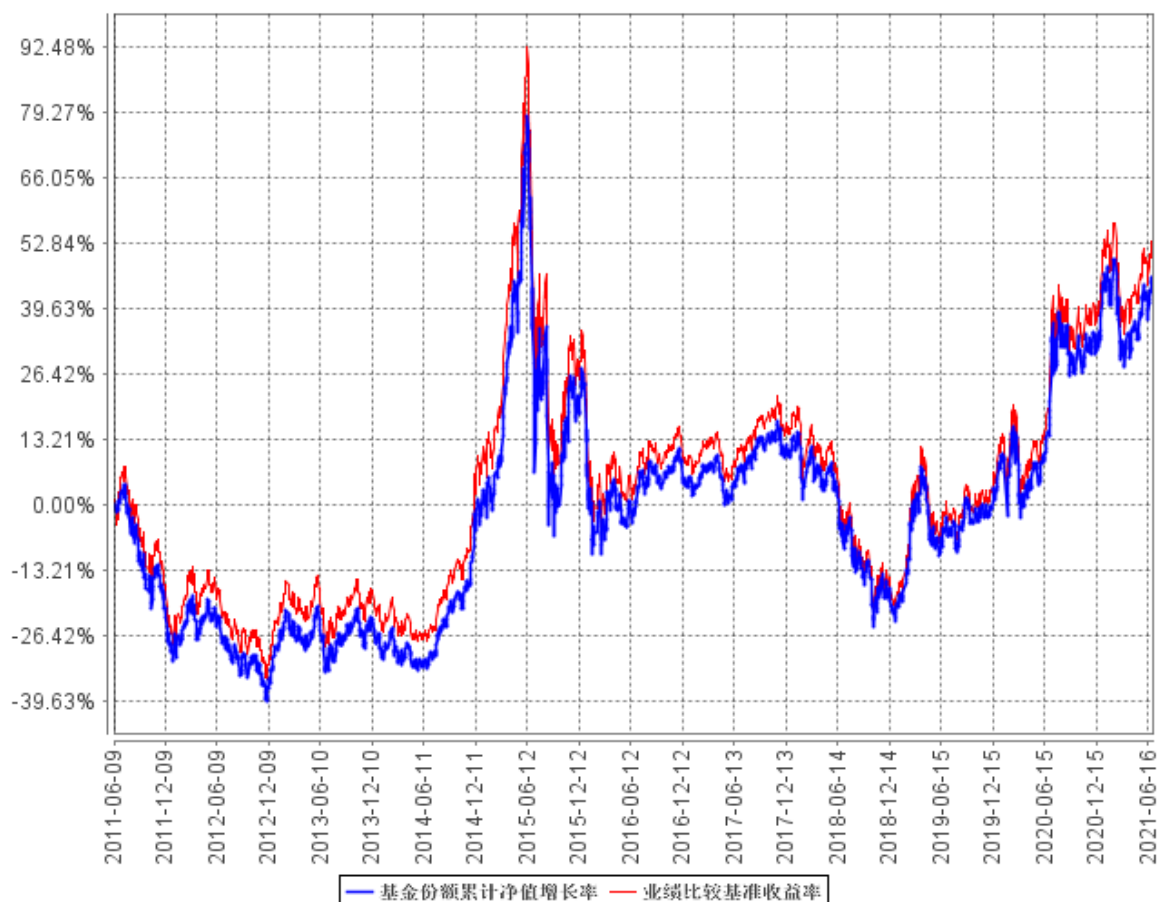
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.41%	0.97%	1.27%	0.99%	0.14%	-0.02%
过去三个月	10.90%	0.98%	10.76%	0.98%	0.14%	0.00%
过去六个月	5.98%	1.31%	6.38%	1.31%	-0.40%	0.00%
过去一年	25.88%	1.38%	26.97%	1.39%	-1.09%	-0.01%
过去三年	52.50%	1.41%	55.17%	1.43%	-2.67%	-0.02%
自基金合同生效起至今	46.35%	1.52%	53.67%	1.52%	-7.32%	0.00%

注：本基金业绩比较基准为：中证 200 指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。

本基金的投资标的为中证 200 指数，且本基金现金以及到期日在一年之内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此本基金将业绩比较基准定为中证 200 指数收益率 \times 95% + 商业银行活期存款利率(税后) \times 5%。

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 2011 年 6 月 9 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 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，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、以上日期均是指公司公告的日期；

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投

资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，亦无其他异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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 1.04%。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 1.435 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.98%，业绩比较基准收益率为 6.38%。

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 200 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

一、基金合同关于利润分配的约定：

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、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 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

4、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；

5、法律法规或监管机构另有规定的，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 3 月 8 日至 2021 年 4 月 21 日、2021 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 30 日有连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰信中证 200 指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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 200 指数证券投资基金

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 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	956,431.71	3,425,612.37
结算备付金		5,890.19	-
存出保证金		12,633.54	4,978.25
交易性金融资产	6.4.7.2	14,727,924.32	48,111,679.96
其中：股票投资		14,727,924.32	48,111,679.96
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	96.46	337.38
应收股利		-	-
应收申购款		5,922.89	2,835.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		15,708,899.11	51,545,443.05
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		2,172.90	52,945.64
应付管理人报酬		8,808.79	29,491.33
应付托管费		1,887.61	6,319.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	32,870.23	15,952.30
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	59,318.82	88,735.47
负债合计		105,058.35	193,444.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	10,875,667.43	37,924,130.88
未分配利润	6.4.7.10	4,728,173.33	13,427,867.87
所有者权益合计		15,603,840.76	51,351,998.75
负债和所有者权益总计		15,708,899.11	51,545,443.05

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.435 元，基金份额总额 10,875,667.43 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,398,199.28	5,474,488.49
1.利息收入		4,989.71	9,465.16
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,989.71	9,465.16
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,030,191.85	726,852.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,915,637.97	413,818.11
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	114,553.88	313,034.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,641,228.44	4,733,936.88
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	4,246.16	4,233.65
减：二、费用		327,130.13	331,175.59

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	148,662.07	183,874.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	31,856.20	39,401.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	74,631.18	38,300.49
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	71,980.68	69,599.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,071,069.15	5,143,312.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,071,069.15	5,143,312.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

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 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）	37,924,130.88	13,427,867.87	51,351,998.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,071,069.15	1,071,069.15
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）	-27,048,463.45	-9,770,763.69	-36,819,227.14
其中：1. 基金申购款	1,477,322.94	563,246.48	2,040,569.42
2. 基金赎回款	-28,525,786.39	-10,334,010.17	-38,859,796.56
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）	10,875,667.43	4,728,173.33	15,603,840.76

项目	上年度可比期间 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）	52,228,665.43	1,737,565.99	53,966,231.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,143,312.90	5,143,312.90
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）	-5,022,160.48	-255,647.40	-5,277,807.88
其中：1.基金申购款	1,778,569.99	89,612.19	1,868,182.18
2.基金赎回款	-6,800,730.47	-345,259.59	-7,145,990.06
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）	47,206,504.95	6,625,231.49	53,831,736.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____高宇_____	_____叶振宇_____	_____叶振宇_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信中证 200 指数证券投资基金（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[2011]第 534 号《关于核准泰信中证 200 指数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 200 指数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 316,771,140.56 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(2011)第 228 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 316,786,119.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 14,978.82 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《泰信中证 200 指数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、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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的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。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。本基金的业绩比较基准为：中证 200 指数收益率 \times 95%+商业银行活期存款利率（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	956,431.71
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：	956,431.71

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	10,995,886.68	14,727,924.32	3,732,037.64
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	10,995,886.68	14,727,924.32	3,732,037.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	89.08
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	2.34
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	5.04
合计	96.46

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	32,870.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	32,870.23

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	8.20

应付证券出借违约金	-
预提费用	57,623.16
应付指数使用费	1,687.46
合计	59,318.82

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	37,924,130.88	37,924,130.88
本期申购	1,477,322.94	1,477,322.94
本期赎回(以“-”号填列)	-28,525,786.39	-28,525,786.39
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	10,875,667.43	10,875,667.43

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	19,045,549.50	-5,617,681.63	13,427,867.87
本期利润	9,712,297.59	-8,641,228.44	1,071,069.15
本期基金份额交易产生的变动数	-15,957,997.37	6,187,233.68	-9,770,763.69
其中：基金申购款	835,196.64	-271,950.16	563,246.48
基金赎回款	-16,793,194.01	6,459,183.84	-10,334,010.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,799,849.72	-8,071,676.39	4,728,173.33

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
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	94.15
其他	35.05
合计	4,989.71

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	37,687,065.71
减：卖出股票成本总额	27,771,427.74
买卖股票差价收入	9,915,637.97

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期本基金无债券投资收益。

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

本基金本报告期末未投资贵金属。

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	114,553.88
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	114,553.88

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	-8,641,228.44
——股票投资	-8,641,228.44
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-8,641,228.44

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	4,246.16
合计	4,246.16

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，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。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 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	74,631.18
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	74,631.18

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	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费手续费	1,110.00
债券账户维护费	9,000.00
指数使用费	4,247.52
账户维护费	-
合计	71,980.68

注：根据《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》，本基金的指数许可使用基点费从基金财产中列支，按前一日的基金资产净值的 0.02% 年费率计提，收取下限为每季 5 万元，逐日累计，每季支付一次。该下限超出正常指数使用基点费的部分（即：每季指数许可使用基点费下限—该季指数许可使用基点费）由本基金的基金管理人自行承担，不作为基金费用从基金财产中列支。计算方法如下：日指数许可使用费=前一日基金资产净值×0.02%/当年天数。

6.4.7.21 分部报告

无。

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	148,662.07	183,874.31
其中：支付销售机构的客	19,015.27	37,689.67

户维护费		
------	--	--

注：2020 年 12 月 31 日前本基金的管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提本基金的管理费，管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	31,856.20	39,401.63

注：2020 年 12 月 31 日前本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提本基金的托管费，托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

本报告期及上年度可比期间本基金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

本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	6,037,101.35	19,037,101.35
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	-	4,000,000.00
报告期末持有的基金份额	6,037,101.35	15,037,101.35
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	55.51%	31.85%

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		上年度末	
	2021 年 6 月 30 日		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%	26,439,218.54	69.72%

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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		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
中国银行	956,431.71	4,860.51	3,358,619.95	9,381.76

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配的情况。

6.4.12 期末（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
002024	苏宁易购	2021 年 6 月 16 日	重大事项	5.59	2021 年 7 月 6 日	6.15	7,500	41,925.00	41,925.00	-

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债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事

会、董事会及下设风险控制委员会、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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2020 年 12 月 31 日：同。）

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金

通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 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 0.2687%。

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 15,642,431.03 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风

险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资。利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	956,431.71	-	-	-	956,431.71
结算备付金	5,890.19	-	-	-	5,890.19
存出保证金	12,633.54	-	-	-	12,633.54
交易性金融资产	-	-	-	14,727,924.32	14,727,924.32
应收利息	-	-	-	96.46	96.46
应收申购款	-	-	-	5,922.89	5,922.89
资产总计	974,955.44	-	-	14,733,943.67	15,708,899.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,172.90	2,172.90
应付管理人报酬	-	-	-	8,808.79	8,808.79
应付托管费	-	-	-	1,887.61	1,887.61
应付交易费用	-	-	-	32,870.23	32,870.23
其他负债	-	-	-	59,318.82	59,318.82
负债总计	-	-	-	105,058.35	105,058.35
利率敏感度缺口	974,955.44	-	-	14,628,885.32	15,603,840.76
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	3,425,612.37	-	-	-	3,425,612.37
存出保证金	4,978.25	-	-	-	4,978.25
交易性金融资产	-	-	-	48,111,679.96	48,111,679.96
应收利息	-	-	-	337.38	337.38
应收申购款	-	-	-	2,835.09	2,835.09
资产总计	3,430,590.62	-	-	48,114,852.43	51,545,443.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	52,945.64	52,945.64
应付管理人报酬	-	-	-	29,491.33	29,491.33
应付托管费	-	-	-	6,319.56	6,319.56
应付交易费用	-	-	-	15,952.30	15,952.30

其他负债	-	-	88,735.47	88,735.47
负债总计	-	-	193,444.30	193,444.30
利率敏感度缺口	3,430,590.62	-	47,921,408.13	51,351,998.75

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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投资（2020 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（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 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	14,727,924.32	94.39	48,111,679.96	93.69
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	14,727,924.32	94.39	48,111,679.96	93.69

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%	843,562.73	2,535,071.55
2. 业绩比较基准下降 5%	-843,562.73	-2,535,071.55	

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	14,727,924.32	93.76
	其中：股票	14,727,924.32	93.76
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	962,321.90	6.13
8	其他各项资产	18,652.89	0.12
9	合计	15,708,899.11	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	321,817.84	2.06
C	制造业	9,576,625.81	61.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	218,771.79	1.40
E	建筑业	146,395.66	0.94
F	批发和零售业	305,782.88	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	561,956.01	3.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	797,052.15	5.11
J	金融业	1,737,675.03	11.14
K	房地产业	310,441.08	1.99
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	48,388.80	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	526,829.05	3.38
R	文化、体育和娱乐业	176,188.22	1.13
S	综合	-	-
	合计	14,727,924.32	94.39

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	601919	中远海控	9,548	291,595.92	1.87
2	002812	恩捷股份	1,026	240,186.60	1.54
3	002230	科大讯飞	3,511	237,273.38	1.52
4	300014	亿纬锂能	2,235	232,283.55	1.49
5	300274	阳光电源	2,000	230,120.00	1.47
6	300124	汇川技术	3,053	226,715.78	1.45
7	000100	TCL 科技	27,681	211,759.65	1.36
8	603986	兆易创新	1,076	202,180.40	1.30
9	002241	歌尔股份	4,717	201,604.58	1.29
10	300347	泰格医药	1,035	200,065.50	1.28
11	603799	华友钴业	1,737	198,365.40	1.27
12	002271	东方雨虹	3,485	192,790.20	1.24
13	002460	赣锋锂业	1,587	192,169.83	1.23
14	300142	沃森生物	3,089	190,591.30	1.22
15	600763	通策医疗	442	181,662.00	1.16
16	600703	三安光电	5,429	173,999.45	1.12
17	600196	复星医药	2,381	171,741.53	1.10
18	000338	潍柴动力	9,373	167,495.51	1.07
19	600919	江苏银行	23,313	165,522.30	1.06
20	002129	中环股份	4,242	163,741.20	1.05
21	600660	福耀玻璃	2,765	154,425.25	0.99

22	600570	恒生电子	1,648	153,676.00	0.98
23	002371	北方华创	489	135,638.82	0.87
24	000776	广发证券	8,900	134,746.00	0.86
25	688036	传音控股	638	133,661.00	0.86
26	002311	海大集团	1,638	133,660.80	0.86
27	601225	陕西煤业	11,100	131,535.00	0.84
28	002049	紫光国微	838	129,211.22	0.83
29	002410	广联达	1,874	127,806.80	0.82
30	300601	康泰生物	821	122,329.00	0.78
31	300450	先导智能	2,000	120,280.00	0.77
32	000625	长安汽车	4,479	117,708.12	0.75
33	600893	航发动力	2,104	111,911.76	0.72
34	002821	凯莱英	287	106,936.20	0.69
35	601009	南京银行	9,879	103,927.08	0.67
36	300595	欧普康视	1,000	103,550.00	0.66
37	601377	兴业证券	10,563	102,038.58	0.65
38	600132	重庆啤酒	500	98,975.00	0.63
39	300413	芒果超媒	1,405	96,383.00	0.62
40	603882	金城医学	600	95,862.00	0.61
41	600426	华鲁恒升	3,000	92,850.00	0.60
42	603517	绝味食品	1,100	92,719.00	0.59
43	600584	长电科技	2,456	92,542.08	0.59
44	002601	龙蟠佰利	2,652	91,706.16	0.59
45	300408	三环集团	2,149	91,160.58	0.58
46	600111	北方稀土	4,301	89,030.70	0.57
47	601100	恒立液压	1,027	88,239.84	0.57
48	601939	建设银行	13,247	88,092.55	0.56
49	002001	新和成	3,051	87,502.68	0.56
50	600926	杭州银行	5,852	86,317.00	0.55
51	002179	中航光电	1,085	85,736.70	0.55
52	002050	三花智控	3,546	85,033.08	0.54
53	600958	东方证券	8,246	82,377.54	0.53
54	603659	璞泰来	600	81,960.00	0.53
55	002841	视源股份	659	81,907.11	0.52
56	600741	华域汽车	3,112	81,752.24	0.52
57	600600	青岛啤酒	700	80,955.00	0.52
58	300003	乐普医疗	2,494	80,107.28	0.51
59	000963	华东医药	1,726	79,413.26	0.51
60	002007	华兰生物	2,161	79,265.48	0.51

61	000786	北新建材	1,999	78,460.75	0.50
62	000157	中联重科	8,378	77,412.72	0.50
63	601901	方正证券	8,121	76,012.56	0.49
64	600143	金发科技	3,600	75,096.00	0.48
65	688012	中微公司	451	74,829.92	0.48
66	002236	大华股份	3,546	74,820.60	0.48
67	000800	一汽解放	6,900	74,658.00	0.48
68	601155	新城控股	1,783	74,172.80	0.48
69	603806	福斯特	700	73,591.00	0.47
70	600176	中国巨石	4,738	73,486.38	0.47
71	603993	洛阳钼业	13,950	71,982.00	0.46
72	000768	中航西飞	2,733	71,823.24	0.46
73	601877	正泰电器	2,121	70,798.98	0.45
74	600352	浙江龙盛	5,140	70,623.60	0.45
75	600760	中航沈飞	1,161	70,008.30	0.45
76	600010	包钢股份	44,951	69,674.05	0.45
77	601788	光大证券	3,857	69,001.73	0.44
78	600547	山东黄金	3,568	68,576.96	0.44
79	300529	健帆生物	794	68,569.84	0.44
80	601600	中国铝业	12,891	68,322.30	0.44
81	002008	大族激光	1,682	67,935.98	0.44
82	601799	星宇股份	300	67,716.00	0.43
83	603369	今世缘	1,236	66,941.76	0.43
84	601916	浙商银行	16,765	66,557.05	0.43
85	002202	金风科技	5,442	66,174.72	0.42
86	603160	汇顶科技	500	64,815.00	0.42
87	002555	三七互娱	2,623	63,004.46	0.40
88	603899	晨光文具	732	61,897.92	0.40
89	000938	紫光股份	2,821	61,723.48	0.40
90	600989	宝丰能源	4,448	60,848.64	0.39
91	600109	国金证券	4,779	60,645.51	0.39
92	000069	华侨城 A	8,088	60,174.72	0.39
93	600150	中国船舶	3,614	59,667.14	0.38
94	300136	信维通信	1,926	59,474.88	0.38
95	000425	徐工机械	9,266	59,024.42	0.38
96	601669	中国电建	15,098	58,429.26	0.37
97	002384	东山精密	2,724	56,768.16	0.36
98	600795	国电电力	23,277	56,563.11	0.36
99	600079	人福医药	2,000	56,540.00	0.36

100	000977	浪潮信息	2,006	56,428.78	0.36
101	601238	广汽集团	4,356	56,410.20	0.36
102	000783	长江证券	7,633	55,873.56	0.36
103	688008	澜起科技	893	55,705.34	0.36
104	600085	同仁堂	1,360	55,556.00	0.36
105	603019	中科曙光	2,003	55,302.83	0.35
106	002624	完美世界	2,299	54,969.09	0.35
107	000596	古井贡酒	227	54,366.50	0.35
108	300558	贝达药业	500	54,120.00	0.35
109	601838	成都银行	4,272	53,998.08	0.35
110	600183	生益科技	2,262	52,953.42	0.34
111	600886	国投电力	5,492	52,778.12	0.34
112	600029	南方航空	8,735	52,584.70	0.34
113	000703	恒逸石化	4,390	52,460.50	0.34
114	601985	中国核电	10,325	52,244.50	0.33
115	300144	宋城演艺	3,098	52,046.40	0.33
116	601108	财通证券	4,956	51,988.44	0.33
117	002600	领益智造	5,568	51,169.92	0.33
118	002414	高德红外	1,853	51,105.74	0.33
119	601555	东吴证券	6,117	51,015.78	0.33
120	002252	上海莱士	6,801	50,939.49	0.33
121	603833	欧派家居	357	50,679.72	0.32
122	000066	中国长城	3,462	50,545.20	0.32
123	300677	英科医疗	400	49,920.00	0.32
124	601077	渝农商行	12,448	49,667.52	0.32
125	002044	美年健康	5,405	49,239.55	0.32
126	000728	国元证券	6,120	48,776.40	0.31
127	300676	华大基因	408	48,388.80	0.31
128	600522	中天科技	4,835	48,350.00	0.31
129	601607	上海医药	2,279	48,155.27	0.31
130	300033	同花顺	424	47,818.72	0.31
131	002602	世纪华通	7,347	47,167.74	0.30
132	600332	白云山	1,387	46,949.95	0.30
133	600161	天坛生物	1,355	46,408.75	0.30
134	600872	中炬高新	1,101	46,264.02	0.30
135	600845	宝信软件	907	46,166.30	0.30
136	601800	中国交建	7,100	46,008.00	0.29
137	601111	中国国航	5,894	45,855.32	0.29
138	600362	江西铜业	2,048	45,834.24	0.29

139	600383	金地集团	4,454	45,608.96	0.29
140	688396	华润微	500	45,510.00	0.29
141	600115	中国东航	8,840	44,907.20	0.29
142	300628	亿联网络	535	44,833.00	0.29
143	002508	老板电器	935	43,477.50	0.28
144	000860	顺鑫农业	1,024	43,192.32	0.28
145	600061	国投资本	5,078	43,112.22	0.28
146	002916	深南电路	386	42,896.18	0.27
147	601727	上海电气	10,084	42,756.16	0.27
148	601162	天风证券	8,725	42,403.50	0.27
149	601618	中国中冶	14,080	41,958.40	0.27
150	002024	苏宁易购	7,500	41,925.00	0.27
151	000708	中信特钢	1,990	41,471.60	0.27
152	601021	春秋航空	724	41,195.60	0.26
153	600705	中航资本	10,568	40,898.16	0.26
154	601878	浙商证券	3,061	40,037.88	0.26
155	600606	绿地控股	7,300	39,785.00	0.25
156	603939	益丰药房	700	39,263.00	0.25
157	601990	南京证券	3,707	38,997.64	0.25
158	002456	欧菲光	4,245	37,695.60	0.24
159	002157	正邦科技	3,109	37,152.55	0.24
160	002463	沪电股份	2,382	36,849.54	0.24
161	000656	金科股份	6,324	36,615.96	0.23
162	600011	华能国际	8,664	36,562.08	0.23
163	601933	永辉超市	7,600	35,948.00	0.23
164	600655	豫园股份	3,065	35,523.35	0.23
165	600521	华海药业	1,700	35,496.00	0.23
166	600118	中国卫星	1,165	34,087.90	0.22
167	603392	万泰生物	131	33,952.58	0.22
168	601696	中银证券	1,646	33,891.14	0.22
169	601216	君正集团	6,657	33,884.13	0.22
170	600848	上海临港	1,878	33,616.20	0.22
171	600489	中金黄金	3,826	32,980.12	0.21
172	002558	巨人网络	2,405	31,986.50	0.20
173	002120	韵达股份	2,289	30,970.17	0.20
174	601872	招商轮船	6,455	29,822.10	0.19
175	603338	浙江鼎力	500	29,345.00	0.19
176	688126	沪硅产业	1,000	29,180.00	0.19
177	002673	西部证券	3,532	29,139.00	0.19

178	688009	中国通号	5,094	28,984.86	0.19
179	002739	万达电影	1,758	27,758.82	0.18
180	601881	中国银河	2,550	27,489.00	0.18
181	603658	安图生物	347	26,292.19	0.17
182	603233	大参林	500	25,555.00	0.16
183	603195	公牛集团	126	25,452.00	0.16
184	600233	圆通速递	2,500	25,025.00	0.16
185	600482	中国动力	1,281	22,315.02	0.14
186	601231	环旭电子	1,311	22,037.91	0.14
187	002153	石基信息	889	20,900.39	0.13
188	600025	华能水电	3,562	20,623.98	0.13
189	002032	苏泊尔	321	20,476.59	0.13
190	600340	华夏幸福	3,906	20,467.44	0.13
191	002939	长城证券	1,835	20,423.55	0.13
192	601236	红塔证券	1,439	19,512.84	0.13
193	002773	康弘药业	728	16,838.64	0.11
194	601808	中海油服	1,166	16,743.76	0.11
195	601698	中国卫通	871	14,101.49	0.09
196	603087	甘李药业	122	13,002.76	0.08
197	600299	安迪苏	817	9,771.32	0.06
198	002945	华林证券	535	7,393.70	0.05

7.3.2 期末积极投资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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

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	600919	江苏银行	213,000.00	0.41
2	300274	阳光电源	195,140.00	0.38
3	601225	陕西煤业	136,817.00	0.27
4	000776	广发证券	133,886.00	0.26
5	300450	先导智能	126,349.20	0.25
6	002311	海大集团	119,641.00	0.23
7	300595	欧普康视	104,304.40	0.20

8	601216	君正集团	99,864.00	0.19
9	600426	华鲁恒升	99,836.00	0.19
10	603882	金域医学	85,942.00	0.17
11	600132	重庆啤酒	85,898.00	0.17
12	603517	绝味食品	85,871.00	0.17
13	000800	一汽解放	75,348.00	0.15
14	600143	金发科技	73,728.00	0.14
15	603659	璞泰来	70,254.00	0.14
16	603806	福斯特	64,636.00	0.13
17	601799	星宇股份	63,933.00	0.12
18	603160	汇顶科技	58,363.00	0.11
19	600079	人福医药	53,188.00	0.10
20	688036	传音控股	52,866.00	0.10

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	600436	片仔癀	845,278.78	1.65
2	600438	通威股份	768,140.66	1.50
3	000100	TCL 科技	672,385.00	1.31
4	300014	亿纬锂能	632,065.80	1.23
5	601919	中远海控	572,871.61	1.12
6	300142	沃森生物	557,598.34	1.09
7	002230	科大讯飞	552,179.41	1.08
8	002271	东方雨虹	542,400.35	1.06
9	300124	汇川技术	538,574.55	1.05
10	002460	赣锋锂业	493,240.84	0.96
11	300347	泰格医药	480,457.48	0.94
12	000338	潍柴动力	475,044.23	0.93
13	002311	海大集团	466,255.30	0.91
14	002241	歌尔股份	460,600.57	0.90
15	600570	恒生电子	424,460.67	0.83
16	600196	复星医药	420,962.13	0.82
17	002493	荣盛石化	420,683.76	0.82

18	600660	福耀玻璃	394,542.40	0.77
19	002410	广联达	378,767.05	0.74
20	002812	恩捷股份	377,023.12	0.73

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	3,028,900.54
卖出股票收入（成交）总额	37,687,065.71

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

本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

本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	12,633.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	96.46
5	应收申购款	5,922.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,652.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有的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

7.12.5.1 期末指数投资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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

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
644	16,887.68	6,037,101.35	55.51%	4,838,566.08	44.49%

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（2011 年 6 月 9 日）基金份额总额	316,786,119.38
本报告期期初基金份额总额	37,924,130.88
本报告期基金总申购份额	1,477,322.94
减:本报告期基金总赎回份额	28,525,786.39
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	10,875,667.43

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

本报告期内,无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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	
东方财富证券	1	20,985,009.91	51.54%	15,346.47	46.04%	-
招商证券	1	17,628,815.47	43.30%	16,065.15	48.20%	-
东吴证券	2	1,600,527.87	3.93%	1,458.61	4.38%	-
国泰君安	1	257,973.00	0.63%	235.08	0.71%	-
光大证券	1	243,640.00	0.60%	226.91	0.68%	-

华金证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

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

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 49787，南京证券 49825，德邦证券 50643；本报告期无退租交易单元。

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
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

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	2020 年 4 季度报告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 1 月 21 日
2	基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 1 月 22 日
3	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	《中国证券报》及规定网站	2021 年 1 月 27 日
4	在农业银行开通转换业务	《中国证券报》及规定网站	2021 年 2 月 26 日
5	招募说明书更新、产品资料概要更新	《中国证券报》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	《中国证券报》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	《中国证券报》及规定网站	2021 年 3 月 25 日
8	2020 年年度报告	《中国证券报》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	《中国证券报》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	《中国证券报》及规定网站	2021 年 4 月 1 日
11	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	《中国证券报》及规定网站	2021 年 4 月 8 日

	赎回限额进行调整		
12	2021 年 1 季度报告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 4 月 20 日
13	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	《中国证券报》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 – 20210530	26,439,218.54	0.00	26,439,218.54	0.00	0.00%
	2	20210507 – 20210630	6,037,101.35	0.00	0.00	6,037,101.35	55.51%
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 200 指数证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信中证 200 指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信中证 200 指数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