

# 泰信鑫利混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	20
4.10 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.....	20
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>21</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	21
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>22</b>
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>25</b>
7.1 资产负债表.....	25
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
8.3 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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 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.....	57

8.7 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 .....	58
8.8 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 .....	58
8.9 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 .....	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.12 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.3 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 .....	60
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	60
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
11.2 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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>68</b>
12.1 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 .....	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
13.1 备查文件目录 .....	69
13.2 存放地点 .....	69
13.3 查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰信鑫利混合型证券投资基金	
基金简称	泰信鑫利混合	
基金主代码	004227	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年5月25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	3,118,325.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰信鑫利混合 A	泰信鑫利混合 C
下属分级基金的交易代码:	004227	004228
报告期末下属分级基金的份额总额	1,664,999.90份	1,453,325.35份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用多种投资策略，在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，力争实现长期稳健增值。
投资策略	本基金的股票投资将行业精选和个股精选相结合，在宏观策略研究的基础上优选特定经济周期阶段下的优势行业，在优势行业中发掘具备投资价值的优势个股；在本基金的债券投资过程中，基金管理人将充分发挥在研究方面的专业化优势，采取积极主动的投资管理，以中长期利率趋势分析为基础，结合中长期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。通过确定债券组合久期、确定债券组合期限结构配置和挑选个券等三个步骤构建债券组合，尽可能地控制风险、提高基金投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%
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 华夏银行大厦 36-37 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ftfund.com">http://www.ftfund.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2021 年		2020 年		2019 年	
	泰信鑫利混合 A	泰信鑫利混合 C	泰信鑫利混 合 A	泰信鑫利混 合 C	泰信鑫利混合 A	泰信鑫利混合 C
本期 已实 现收 益	-23,681.62	-3,100,933.57	193,673.20	1,379,405.34	466,032.21	1,098,935.47
本期 利润	157,961.64	-3,189,392.85	91,161.20	1,368,064.38	586,584.64	1,381,757.78
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.1593	-0.4021	0.0265	0.0592	0.0649	0.0591
本期 加权 平均 净值 利润 率	13.40%	-38.12%	2.39%	5.31%	6.11%	5.60%
本期 基金 份额 净值 增长 率	13.82%	13.33%	5.83%	5.45%	6.17%	5.75%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	76,911.88	39,437.52	95,174.68	2,884,131.09	505,558.22	1,552,757.13

期末可供分配基金份额利润	0.0462	0.0271	0.1414	0.1261	0.0773	0.0667
期末基金资产净值	2,193,719.72	1,880,929.38	779,347.38	26,125,232.39	7,156,590.74	25,224,074.67
期末基金份额净值	1.3175	1.2942	1.1575	1.1420	1.0937	1.0830
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	31.75%	29.42%	15.75%	14.20%	9.37%	8.30%

注：1、本基金合同生效日为 2017 年 5 月 25 日。

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。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰信鑫利混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.81%	1.27%	1.45%	0.23%	3.36%	1.04%
过去六个月	23.73%	1.56%	0.71%	0.31%	23.02%	1.25%
过去一年	13.82%	1.36%	2.63%	0.35%	11.19%	1.01%
过去三年	27.90%	0.81%	29.06%	0.38%	-1.16%	0.43%
自基金合同	31.75%	0.65%	33.64%	0.37%	-1.89%	0.28%



生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

## 泰信鑫利混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.71%	1.27%	1.45%	0.23%	3.26%	1.04%
过去六个月	23.48%	1.56%	0.71%	0.31%	22.77%	1.25%
过去一年	13.33%	1.36%	2.63%	0.35%	10.70%	1.01%
过去三年	26.37%	0.81%	29.06%	0.38%	-2.69%	0.43%
自基金合同生效起至今	29.42%	0.65%	33.64%	0.37%	-4.22%	0.28%

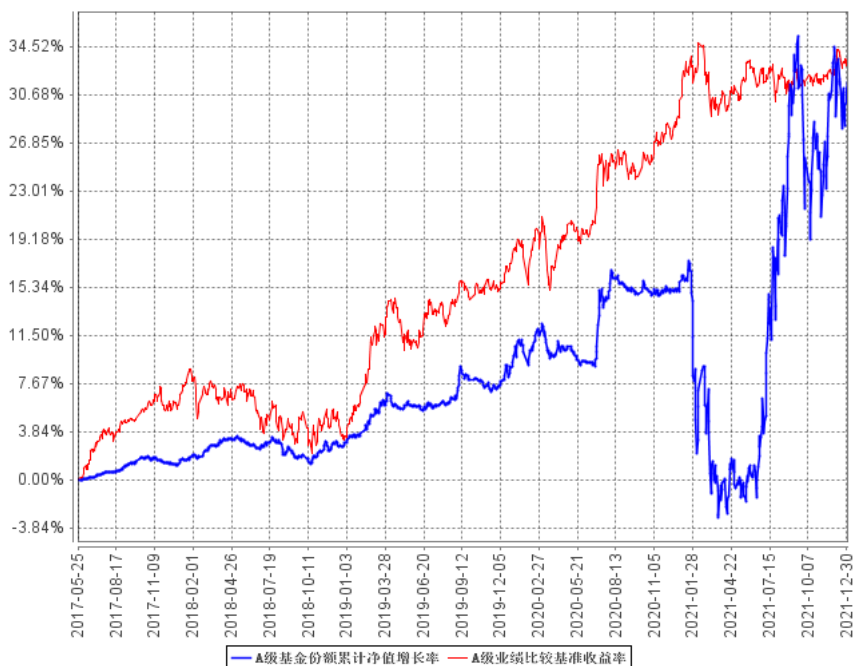
注：沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%

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。

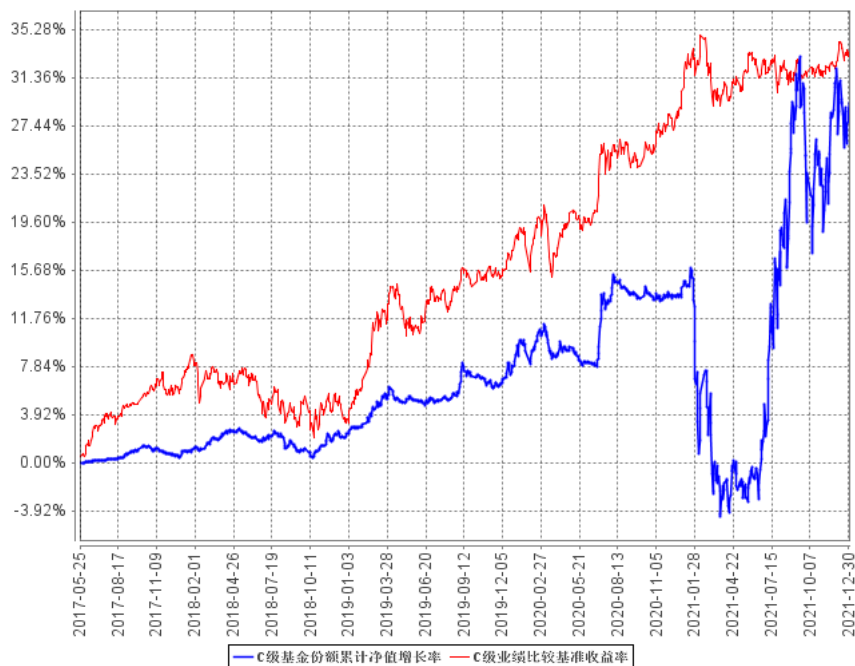
2、中证全债指数以银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券为样本，是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有良好的债券市场代表性，运用较为广泛。

### 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

A级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



C级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

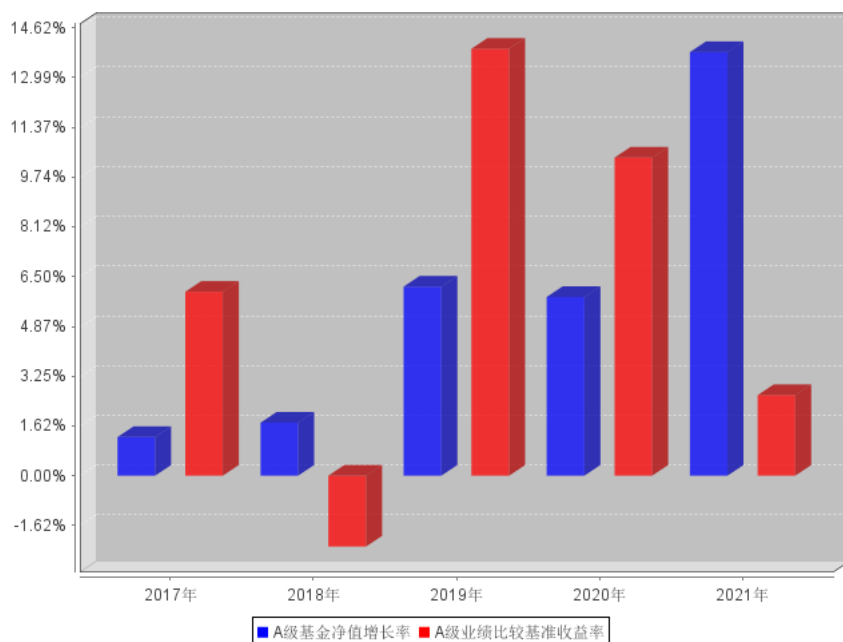


注：1、本基金基金合同于 2017 年 5 月 25 日正式生效。

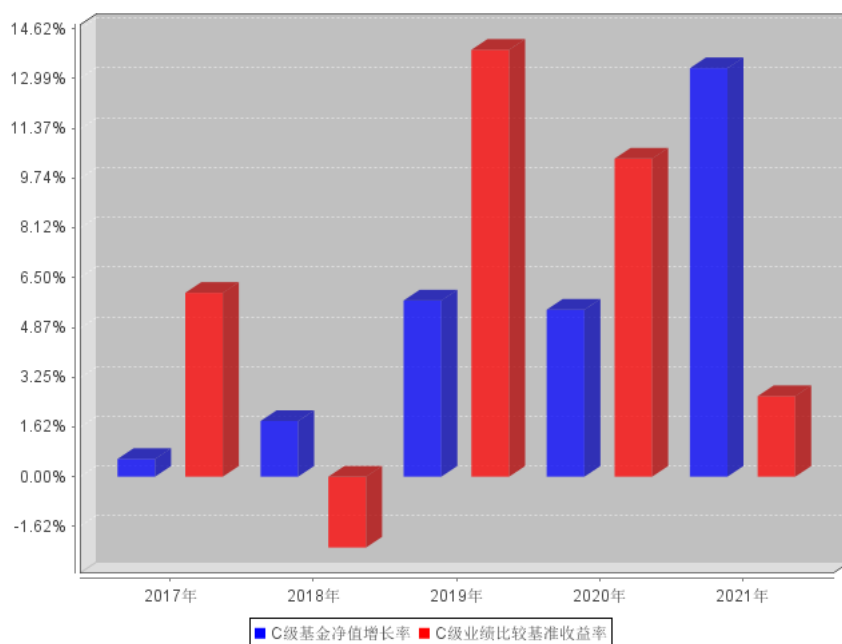
2、本基金建仓期为六个月。建仓期满，基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例不超过 30%；基金持有全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2017 年 5 月 25 日正式生效，2017 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

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

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督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。

经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]2848 号文核准，泰信基金管理有限公司原股东山东省国际信托股份有限公司将其持有的本公司 45%股权转让给山东省鲁信投资控股集团有限公司。本次股权变更后，本公司的注册资本保持不变，公司股权结构如下：山东省鲁信投资控股集团有限公司出资 9000 万元，占公司总股本的 45%；江苏省投资管理有限责任公司出资 6000 万元，占公司总股本的 30%；青岛国信实业有限公司出资 5000 万元，占公司总股本的 25%。

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 12 月底，公司有正式员工 100 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 12 月 31 日，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债

券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信基本面 400、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长混合、泰信鑫利混合、泰信竞争优势混合、泰信双债增利债券、泰信景气驱动 12 个月持有期混合、泰信汇享利率债债券、泰信低碳经济混合、泰信均衡价值混合、泰信汇利三个月定期开放债券、泰信医疗服务混合共 28 只开放式基金及 31 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		
张安格女士	泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理、泰信汇享利率债债券型证券投资基金基金经理	2021 年 2 月 1 日	-	6 年	张安格女士，硕士，具有基金从业资格。曾任职于申万宏源证券有限公司资产管理事业部，从事固定收益类产品的设计、交易、研究及投资。2020 年 12 月加入泰信基金管理有限公司拟任基金经理。2021 年 2 月至今任泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任泰信汇享利率债债券型证券投资基金基金经理。
郑宇光先生	固收投资部总监兼基金经理、泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理、泰信增强收益债券型证券投资基金基金经理、泰信周期回报债券型证券投资基金基金经理	2021 年 1 月 13 日	-	16 年	郑宇光先生，上海交通大学工商管理专业硕士，北京大学金融学专业与应用数学专业本科，历任平安资产管理有限责任公司交易员、投资组合经理，太平资产管理有限公司投资经理，上投摩根基金管理有限公司投资经理，中信保诚基金管理有限公司投资经理，长江证券（上海）资产管理有限公司投资经理，上海勤远投资管理中心（有限合伙）基金经理。2020 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，历任专户投资部副总监、基金投资部副总监、基金投资部副

	理，泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理、泰信双债增利债券型证券投资基金基金经理。				总监兼基金经理，现任固收投资部总监兼基金经理。2020年9月至今任泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理；2020年10月至今任泰信增强收益债券型证券投资基金基金经理，2020年10月至今任泰信周期回报债券型证券投资基金基金经理，2021年1月至今任泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理、2021年6月至今任泰信双债增利债券型证券投资基金基金经理。
何俊春女士	固定收益投资总监、泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金经理、泰信双债增利债券型证券投资基金基金经理	2017年5月25日	2021年1月13日	24年	何俊春女士，华东理工大学工商管理专业硕士。历任上海鸿安投资咨询有限公司清算员、齐鲁证券有限公司上海斜土路营业部项目经理。2002年12月加入泰信基金管理有限公司，历任交易员、交易主管，现任固定收益投资总监。2008年10月至2020年9月任泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理，2009年7月至2020年10月任泰信增强收益债券型证券投资基金基金经理，2012年10月至2020年10月任泰信周期回报债券型证券投资基金基金经理，2013年7月至2021年6月任泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016年10月至2021年2月任泰信天天收益货币市场基金基金经理，2017年5月至2021年1月任泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理，2021年3月至2021年6月任泰信双债增利债券型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期是指基金合同生效日期。

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》、《泰信鑫利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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18号），公司制定了《泰信基金管理有限公司公平交易制度》，主要控制方法如下：

- 1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。
- 2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。
- 3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。
- 4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

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。

5、集中交易室负责所有投资指令的执行，必须确保所有同向指令的公平公正，平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令，交易室应立即停止执行指令，并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令，不同投资组合也必须公平对待，主要采取成交结果按比例分配和轮候方式处理。

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的同时反向交易，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。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数，强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析，对强制公平委托的执行过程与结果进行检查；对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，并完成定期分析报告。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年 A 股市场呈现出明显的结构性行情，年初以“茅指数”为代表的价值股涨幅较大，但春节过后茅指数突然变盘，带动 A 股市场整体经历了一波回调。4 月初，伴随这次回调的结束，A 股风格转换，开启了结构性行情，新能源、半导体、锂矿、钢铁、医美、CXO、白酒等板块轮番表现。到了 6、7 月份，结构性行情表现得更为极致，市场热点基本集中在新能源板块。进入 8 月份以后，以煤炭为代表的周期板块展现出惊人的爆发力，涨幅巨大。而消费、医药等板块继续下挫，半导体也出现回调，新能源板块则出现内部分化；市场整体来看，中小盘股票走势明显优于大盘股走势。9 月中旬以后，伴随政策因素，周期股出现大幅回调，连带前期涨幅较大的高景气板块也跟随调整，而消费、银行、地产等板块反弹。尽管后期新能源板块有所修复，但上涨动能很弱，很快进入横盘整理状态，部分细分赛道甚至出现下行趋势。进入 12 月份后，市场对稳增长的预期



不断升温，地产链及基建相关板块走强，消费、家电有所反弹。尽管此类标的在基本上尚未出现明确的拐点，但预期的改善已催生了一小波行情。

债券方面，年初资金面的短期紧张及社融放量使债券市场出现回调，但随着资金面重回合理充裕，地方债供给低于预期，经济下行压力增大，债券市场收益率重拾下行趋势。7 月份央行超预期降准更是打开了债券收益率的下限。尽管 10 月份央行略显鹰派的表态使得市场对进一步降准降息的预期有所减弱，债市出现了回调，但是收益率很快被积极的配置盘买了下去，且 12 月二次降准之后，债券市场的多头力量显得更为强大。

2021 年，本基金改变了以往的操作思路，希望能够通过更多积极主动的操作，使得基金的净值有较好的表现。整体来看，本基金在 2021 年度把握了一些新能源及周期板块的机会，但是在回撤控制上还有待改进，今后需要努力为基金投资人创造更好的持有体验。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰信鑫利混合 A 基金份额净值为 1.3175 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.82%；截至本报告期末泰信鑫利混合 C 基金份额净值为 1.2942 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.33%；同期业绩比较基准收益率为 2.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益方面，2022 年市场的波动可能会加剧，重点可以关注两条主线机会：一是稳增长板块。在经济走弱、稳增长诉求强烈的背景下，往往能见到降准降息、基建发力、地产边际放松的政策组合拳。未来稳增长板块会有机会，但不是普涨的状态。需要仔细甄别真正受益于稳增长政策的领域，挖掘运营能力优秀的公司，持续跟踪标的的业绩兑现情况，在合理的估值范围内做仓位有限的配置。二是高景气板块。经历近期的调整，以新能源为代表的高景气行业估值已经回落至合理水平，部分细分领域甚至已低于历史均值水平。而这些景气赛道的公司在未来几年的业绩增速会远高于 A 股上市公司的平均业绩增速，其当前的估值性价比更具吸引力。真正的成长型公司尽管会遭遇短期的波动，但是长期来看却拥有穿越经济周期的能力，这些标的值得坚定持有和超配，长期也终将得到市场的认可。

债券方面，需要关注“宽信用”、“宽货币”和“宽财政”三者对市场影响的角力。短期来看，降准降息打开了债券收益率的下限。为了配合“宽信用”、“宽财政”政策的实施，央行有必要采取“宽货币”的政策来维持市场流动性的合理充裕。在“宽信用”实际见效之前，市场会更偏于围绕“宽货币”来进行交易。资金面的宽松将有利于债券的杠杆交易，息差策略的大规模使用亦会促使增加债券收益率的下行动能。随着资管新规过渡期的结束，机构对标准化资产的配置需求

更为强烈，配置盘的强大购买力会使债券市场显示出更强的抗跌韧性。尽管 2022 年 1 月份的社融数据大超预期，但是市场对其持续性仍存在一定的疑虑，在宽信用被完全证实之前，债市的回调会是一个较好的配置时点。下半年，我们则需要关注经济数据企稳、宽信用落实情况、CPI 抬升及美国加息进程对市场情绪的扰动。但是放在一个更长的时间维度来看，人口结构调整、资本及科技对经济边际贡献下行，会使经济增长趋缓，在此影响下无风险利率也将趋势性下行。在这一过程中，持有债券类资产除了获得票息收益，还有较大的可能性获得资本利得。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人合规管理及内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。

##### 1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规，及时补充及完善了内部管理制度，同时对业务流程进一步梳理，严格按照监管要求进行风险控制评估及合规管理有效性评估，确保风险控制及合规管理的有效性，不断提升内部控制水平。

##### 2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制。

(1) 加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议、政策法规规定对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。根据证监会发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，制定和修订了一系列公司相关制度和流程，加强了对旗下公募基金的流动性管控，包括投资指标阈值设置、交易对手及质押品管控等。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集，提示投研部门注意投资风险。

(2) 规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易，对基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标进行预警监控。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

3、针对基金投资运作通过日常监察与专项稽核相结合，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，通过查漏补缺、及时整改强化了风险控制流程，提高了投资管理及运营相关人员的风险意识

水平，从而较好地预防风险，维护基金持有人利益。

4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

5、公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽，对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。本年度进一步加强对投研人员的通讯管理，更新了手机保管设备，对基金经理、交易人员在交易时间的移动电话、掌上电脑等移动通讯工具实行集中管理，规范了手机上交异常记录表，不定期抽查；对基金经理集中区域进行录像监控，对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内，本基金的投资运作各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

##### 1、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相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同，本基金同一类别的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。

2、本报告期本基金未进行利润分配。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

无。

#### **4.10 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 9 月 14 日有连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情况，本报告期本基金于 2021 年 1 月 4 日至 2021 年 12 月 31 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。

## § 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”）在泰信鑫利混合型证券投资基金（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、基金净值收益率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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P00142 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信鑫利混合型证券投资基金全体持有人；
审计意见	<p>我们审计了泰信鑫利混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了泰信鑫利混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰信鑫利混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>泰信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括泰信鑫利混合型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泰信鑫利混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算泰信鑫利混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰信鑫利混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对泰信鑫利混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结</p>

	<p>论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰信鑫利混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	李冰雯 谭麟林
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日



## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：泰信鑫利混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	109,944.65	7,348,755.13
结算备付金		25,575.32	360,064.12
存出保证金		499.44	15,523.68
交易性金融资产	7.4.7.2	3,804,279.26	16,315,360.00
其中：股票投资		1,141,713.26	4,239,760.00
基金投资		-	-
债券投资		2,662,566.00	12,075,600.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	200,000.00	-
应收证券清算款		100,129.86	3,875,625.42
应收利息	7.4.7.5	3,686.93	129,458.59
应收股利		-	-
应收申购款		7,243.89	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,251,359.35	28,044,786.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		84,007.45	906,375.35
应付赎回款		55,914.31	34,251.06
应付管理人报酬		4,330.84	27,246.02
应付托管费		721.80	4,541.00
应付销售服务费		720.67	8,807.56
应付交易费用	7.4.7.7	868.72	78,977.20
应交税费		16.96	8.98
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	30,129.50	80,000.00
负债合计		176,710.25	1,140,207.17
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,118,325.25	23,549,449.97
未分配利润	7.4.7.10	956,323.85	3,355,129.80
所有者权益合计		4,074,649.10	26,904,579.77
负债和所有者权益总计		4,251,359.35	28,044,786.94

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 3,118,325.25 份，其中泰信鑫利混合 A 基金份额净值人民币 1.3175 元，份额总额 1,664,999.90 份；泰信鑫利混合 C 基金份额净值人民币 1.2942 元，份额总额 1,453,325.35 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰信鑫利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-2,725,559.37	2,581,142.37
1.利息收入		63,341.17	330,564.36
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,671.74	76,509.99
债券利息收入		45,877.70	178,226.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,791.73	75,827.89
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,897,172.99	2,360,493.69
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-495,264.41	1,185,660.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,403,273.26	1,158,445.25
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,364.68	16,388.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	93,183.98	-113,852.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	15,088.47	3,937.28

列)			
<b>减：二、费用</b>		305,871.84	1,121,916.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	116,221.24	355,808.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	19,370.21	59,301.45
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	34,018.03	103,002.82
4. 交易费用	7.4.7.19	56,340.02	479,168.75
5. 利息支出		8,460.02	42.33
其中：卖出回购金融资产支出		8,460.02	42.33
6. 税金及附加		46.72	43.08
7. 其他费用	7.4.7.20	71,415.60	124,549.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3,031,431.21	1,459,225.58
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3,031,431.21	1,459,225.58

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信鑫利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	23,549,449.97	3,355,129.80	26,904,579.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,031,431.21	-3,031,431.21
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）	-20,431,124.72	632,625.26	-19,798,499.46
其中：1. 基金申购款	5,241,987.24	1,259,039.49	6,501,026.73
2. 基金赎回款	-25,673,111.96	-626,414.23	-26,299,526.19
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	3,118,325.25	956,323.85	4,074,649.10

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	29,834,834.98	2,545,830.43	32,380,665.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,459,225.58	1,459,225.58
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）	-6,285,385.01	-649,926.21	-6,935,311.22
其中：1. 基金申购款	934,073.59	136,124.91	1,070,198.50
2. 基金赎回款	-7,219,458.60	-786,051.12	-8,005,509.72
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）	23,549,449.97	3,355,129.80	26,904,579.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰信鑫利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 3135 号《关于准予泰信鑫利混合型证券投资基金基金注册的批复》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《泰信鑫利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 459,067,640.24 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(2017)第 564 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信鑫利混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额

总额为 459,187,784.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 120,144.48 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《泰信鑫利混合型证券投资基金基金合同》和《泰信鑫利混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别：A 类基金份额和 C 类基金份额。投资者认购/申购基金时收取认购费、申购费，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；投资者认购/申购基金时不收取认购费、申购费，从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信鑫利混合型证券投资基金合同》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）、权证、股指期货等金融工具，以及债券等金融工具（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例不超过 30%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 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，应当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×30%+中证全债指数收益率×70%。

#### 7.4.2 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2021 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

##### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移、或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产的控制时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的可相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大

程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。

贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### 2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后



的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认,由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

### 3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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相应类别的基金份额进行再投资,且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3. 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值

4. 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,而 C 类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同,在收益分配数额方面可能有所不同,本基金同一类别的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。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不计缴企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日

活期存款	109,944.65	7,348,755.13
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：	109,944.65	7,348,755.13

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,160,101.64	1,141,713.26	-18,388.38
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,391,512.84	2,662,566.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,391,512.84	2,662,566.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,551,614.48	3,804,279.26	252,664.78
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,137,478.50	4,239,760.00	102,281.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,185,650.70	2,192,600.00
	银行间市场	9,832,750.00	9,883,000.00
	合计	12,018,400.70	12,075,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	16,155,879.20	16,315,360.00	159,480.80

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	200,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	30.76	946.21
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	11.50	162.00
应收债券利息	3,741.76	129,707.73
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-97.39	-1,364.35
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	0.30	7.00
合计	3,686.93	129,458.59

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	868.72	78,452.20
银行间市场应付交易费用	-	525.00
合计	868.72	78,977.20

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	129.50	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	30,000.00	80,000.00
合计	30,129.50	80,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰信鑫利混合 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	673,315.00	673,315.00
本期申购	2,704,252.11	2,704,252.11
本期赎回（以“-”号填列）	-1,712,567.21	-1,712,567.21
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	1,664,999.90	1,664,999.90

金额单位：人民币元

泰信鑫利混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,876,134.97	22,876,134.97

本期申购	2,537,735.13	2,537,735.13
本期赎回（以“-”号填列）	-23,960,544.75	-23,960,544.75
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	1,453,325.35	1,453,325.35

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。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰信鑫利混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	95,174.68	10,857.70	106,032.38
本期利润	-23,681.62	181,643.26	157,961.64
本期基金份额交易产生的变动数	5,418.82	259,306.98	264,725.80
其中：基金申购款	24,957.20	658,908.69	683,865.89
基金赎回款	-19,538.38	-399,601.71	-419,140.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,911.88	451,807.94	528,719.82

单位：人民币元

泰信鑫利混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,884,131.09	364,966.33	3,249,097.42
本期利润	-3,100,933.57	-88,459.28	-3,189,392.85
本期基金份额交易产生的变动数	256,240.00	111,659.46	367,899.46
其中：基金申购款	-7,028.41	582,202.01	575,173.60
基金赎回款	263,268.41	-470,542.55	-207,274.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,437.52	388,166.51	427,604.03

#### 7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
活期存款利息收入	3,648.76	73,055.75
定期存款利息收入	-	-

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,887.84	3,257.73
其他	135.14	196.51
合计	5,671.74	76,509.99

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
卖出股票成交总额	19,727,250.87	159,186,149.31
减：卖出股票成本总额	20,222,515.28	158,000,489.06
买卖股票差价收入	-495,264.41	1,185,660.25

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31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	-2,403,273.26	1,158,445.25
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	-2,403,273.26	1,158,445.25

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	56,571,382.92	169,275,761.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	58,751,988.74	166,744,398.34
减：应收利息总额	222,667.44	1,372,917.70



买卖债券差价收入	-2,403,273.26	1,158,445.25
----------	---------------	--------------

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,364.68	16,388.19
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,364.68	16,388.19

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	93,183.98	-113,852.96
——股票投资	-120,669.88	196,023.50
——债券投资	213,853.86	-309,876.46
——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	93,183.98	-113,852.96

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
基金赎回费收入	14,936.58	3,937.28
转出基金补偿费	151.89	-
合计	15,088.47	3,937.28

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

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

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
交易所市场交易费用	56,165.02	475,833.75
银行间市场交易费用	175.00	3,335.00
合计	56,340.02	479,168.75

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	-	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	4,215.60	7,349.64
其他	1,200.00	1,200.00
账户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	71,415.60	124,549.64

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

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
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
山东省鲁信投资控股集团有限公司（“鲁信集团”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司	基金管理人的股东
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	116,221.24	355,808.72
其中：支付销售机构的客户维护费	7,133.94	8,734.91

注：支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

### 7.4.10.2.2 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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	19,370.21	59,301.45

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信鑫利混合 A	泰信鑫利混合 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	30,576.01	30,576.01
中国银行	-	356.53	356.53
合计	-	30,932.54	30,932.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	泰信鑫利混合 A	泰信鑫利混合 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	100,479.68	100,479.68
中国银行	-	52.19	52.19
合计	-	100,531.87	100,531.87

注：支付给销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 级份额：支付的销售服务费按前一日 C 级基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：C 级日基金销售服务费=前一日 C 级基金资产净值 x0.40% ÷ 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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 12 月 31 日	
	泰信鑫利混合 A	泰信鑫利混合 C
基金合同生效日（2017 年 5 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	泰信鑫利混合 A	泰信鑫利混合 C
基金合同生效日（2017 年 5 月 25 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	4,866,154.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	4,866,154.00	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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。

#### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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12月31日		2020年1月1日至2020年12月31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	109,944.65	3,648.76	7,348,755.13	73,055.75

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配的情况。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 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。

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。附注 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6 列示了于本报告期末及上年度末本基金所持有的债券投资的信用评级。

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	154,610.00
AAA 以下	2,506,800.00	524,190.00
未评级	-	11,396,800.00
合计	2,506,800.00	12,075,600.00

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。此处信用证券不包括国债、央票与政策性金融债。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末和上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

**7.4.13.3 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。

**7.4.13.3.1 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以及银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 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，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 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为人民币 4,130,375.88 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	109,944.65	-	-	-	109,944.65
结算备付金	25,575.32	-	-	-	25,575.32
存出保证金	499.44	-	-	-	499.44
交易性金融资产	155,766.00	1,613,093.00	893,707.00	1,141,713.26	3,804,279.26
买入返售金融资产	200,000.00	-	-	-	200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	100,129.86	100,129.86
应收利息	-	-	-	3,686.93	3,686.93
应收申购款	-	-	-	7,243.89	7,243.89
资产总计	491,785.41	1,613,093.00	893,707.00	1,252,773.94	4,251,359.35
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	84,007.45	84,007.45
应付赎回款	-	-	-	55,914.31	55,914.31
应付管理人报酬	-	-	-	4,330.84	4,330.84
应付托管费	-	-	-	721.80	721.80
应付销售服务费	-	-	-	720.67	720.67
应付交易费用	-	-	-	868.72	868.72
应交税费	-	-	-	16.96	16.96
其他负债	-	-	-	30,129.50	30,129.50
负债总计	-	-	-	176,710.25	176,710.25
利率敏感度缺口	491,785.41	1,613,093.00	893,707.00	1,076,063.69	4,074,649.10
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	7,348,755.13	-	-	-	7,348,755.13
结算备付金	360,064.12	-	-	-	360,064.12
存出保证金	15,523.68	-	-	-	15,523.68
交易性金融资产	-	11,458,470.00	617,130.00	4,239,760.00	16,315,360.00
应收证券清算款	-	-	-	3,875,625.42	3,875,625.42
应收利息	-	-	-	129,458.59	129,458.59
资产总计	7,724,342.93	11,458,470.00	617,130.00	8,244,844.01	28,044,786.94
负债					
应付证券清算款	-	-	-	906,375.35	906,375.35
应付赎回款	-	-	-	34,251.06	34,251.06
应付管理人报酬	-	-	-	27,246.02	27,246.02
应付托管费	-	-	-	4,541.00	4,541.00
应付销售服务费	-	-	-	8,807.56	8,807.56
应付交易费用	-	-	-	78,977.20	78,977.20
应交税费	-	-	-	8.98	8.98
其他负债	-	-	-	80,000.00	80,000.00
负债总计	-	-	-	1,140,207.17	1,140,207.17
利率敏感度缺口	7,724,342.93	11,458,470.00	617,130.00	7,104,636.84	26,904,579.77

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
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12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
	1. 市场利率上升 25 个基点	-27,396.83	-79,204.01
	2. 市场利率下降 25 个基点	27,926.61	80,126.94

#### 7.4.13.4.2 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。

## 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	1,141,713.26	28.02	4,239,760.00	15.76
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	1,141,713.26	28.02	4,239,760.00	15.76

## 7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	406,596.24	621,726.99
	2. 业绩比较基准下降 5%	-406,596.24	-621,726.99

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1) 公允价值

## (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

## (b) 以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 3,648,513.26 元，第二层次的余额为人民币 155,766.00 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 4,918,560.00 元，第二层次的余额为人民币

11,396,800.00 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	1,141,713.26	26.86
	其中：股票	1,141,713.26	26.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,662,566.00	62.63
	其中：债券	2,662,566.00	62.63
	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	200,000.00	4.70
	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	135,519.97	3.19
8	其他各项资产	111,560.12	2.62
9	合计	4,251,359.35	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,114,593.26	27.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	27,120.00	0.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,141,713.26	28.02

### 8.2.2 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。

### 8.3 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	002460	赣锋锂业	1,200	171,420.00	4.21
2	600111	北方稀土	3,000	137,400.00	3.37
3	600522	中天科技	7,007	118,838.72	2.92
4	300568	星源材质	3,045	111,842.85	2.74
5	300748	金力永磁	2,371	106,434.19	2.61
6	688198	佰仁医疗	400	101,720.00	2.50
7	600110	诺德股份	6,000	95,700.00	2.35
8	002466	天齐锂业	800	85,600.00	2.10
9	300207	欣旺达	2,000	84,320.00	2.07
10	603678	火炬电子	750	56,737.50	1.39
11	002413	雷科防务	6,000	44,580.00	1.09
12	601601	中国太保	1,000	27,120.00	0.67

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	002413	雷科防务	2,116,123.66	7.87
2	600111	北方稀土	2,079,298.50	7.73
3	000002	万科 A	1,147,198.00	4.26
4	601601	中国太保	944,755.00	3.51
5	300327	中颖电子	928,338.00	3.45

6	300059	东方财富	802,960.00	2.98
7	688008	澜起科技	652,830.00	2.43
8	002185	华天科技	614,000.00	2.28
9	002726	龙大美食	550,795.00	2.05
10	300661	圣邦股份	548,308.00	2.04
11	601636	旗滨集团	524,572.00	1.95
12	601318	中国平安	519,180.00	1.93
13	603005	晶方科技	512,833.00	1.91
14	603136	天目湖	488,138.04	1.81
15	000960	锡业股份	463,100.00	1.72
16	002371	北方华创	450,990.00	1.68
17	300628	亿联网络	298,860.00	1.11
18	000060	中金岭南	297,600.00	1.11
19	300207	欣旺达	291,824.26	1.08
20	000703	恒逸石化	268,642.00	1.00

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	600111	北方稀土	2,114,330.00	7.86
2	002413	雷科防务	1,880,637.59	6.99
3	300059	东方财富	1,246,077.29	4.63
4	300327	中颖电子	1,103,578.00	4.10
5	000002	万科 A	1,095,650.00	4.07
6	601601	中国太保	869,024.00	3.23
7	600519	贵州茅台	775,350.00	2.88
8	002185	华天科技	626,000.00	2.33
9	000858	五粮液	623,222.00	2.32
10	000060	中金岭南	565,489.00	2.10
11	002726	龙大美食	528,868.00	1.97
12	601318	中国平安	506,940.00	1.88
13	601636	旗滨集团	490,176.00	1.82
14	688008	澜起科技	480,676.00	1.79
15	300661	圣邦股份	477,705.00	1.78



16	603136	天目湖	475,397.20	1.77
17	000960	锡业股份	467,200.00	1.74
18	688111	金山办公	406,338.00	1.51
19	002371	北方华创	406,185.96	1.51
20	603501	韦尔股份	395,835.00	1.47

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。

### 8.4.3 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	17,245,138.42
卖出股票收入（成交）总额	19,727,250.87

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	155,766.00	3.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,506,800.00	61.52
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,662,566.00	65.34

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128095	恩捷转债	500	232,285.00	5.70
2	118000	嘉元转债	1,000	189,990.00	4.66
3	118002	天合转债	1,000	177,240.00	4.35
4	110066	盛屯转债	700	175,728.00	4.31
5	123046	天铁转债	500	169,210.00	4.15

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 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。

**8.10.2 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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 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。

**8.11.2 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。

**8.11.3 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。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 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。

**8.12.2 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。

**8.12.3 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	499.44
2	应收证券清算款	100,129.86
3	应收股利	-

4	应收利息	3,686.93
5	应收申购款	7,243.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,560.12

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128095	恩捷转债	232,285.00	5.70
2	118000	嘉元转债	189,990.00	4.66
3	110066	盛屯转债	175,728.00	4.31
4	123046	天铁转债	169,210.00	4.15
5	113616	韦尔转债	168,830.00	4.14
6	127038	国微转债	137,487.00	3.37
7	113615	金诚转债	135,982.00	3.34
8	113025	明泰转债	134,361.00	3.30
9	128017	金禾转债	132,900.00	3.26
10	128046	利尔转债	132,601.00	3.25
11	110074	精达转债	117,485.00	2.88
12	113568	新春转债	112,695.00	2.77
13	110048	福能转债	101,016.00	2.48
14	123109	昌红转债	95,112.00	2.33
15	113048	晶科转债	90,030.00	2.21

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰信鑫利混合 A	166	10,030.12	-	-	1,664,999.90	100.00%
泰信鑫利混合 C	119	12,212.82	-	-	1,453,325.35	100.00%
合计	285	10,941.49	-	-	3,118,325.25	100.00%

### 9.2 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。

### 9.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰信鑫利混合 A	0
	泰信鑫利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰信鑫利混合 A	0
	泰信鑫利混合 C	0
	合计	0

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

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信鑫利混合 A	泰信鑫利混合 C
基金合同生效日（2017 年 5 月 25 日）基金份额总额	204,735,499.79	254,452,284.93
本报告期期初基金份额总额	673,315.00	22,876,134.97
本报告期基金总申购份额	2,704,252.11	2,537,735.13
减：本报告期基金总赎回份额	1,712,567.21	23,960,544.75
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	1,664,999.90	1,453,325.35

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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,总经理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》。

2、经泰信基金管理有限公司总经理办公会审议通过,自 2021 年 1 月 13 日起,郑宇光先生担任本基金基金经理,何俊春不再担任本基金基金经理。具体详情参见 2021 年 1 月 13 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泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理变更的公告》。

3、经泰信基金管理有限公司总经理办公会审议通过,自 2021 年 2 月 1 日起,张安格女士担任本基金基金经理,与郑宇光先生共同管理本基金。具体详情参见 2021 年 2 月 1 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站(www.ftfund.com)上的《泰信基金管理有限公司关于泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理变更的公告》。

本公司上述人事变动已按相关规定进行备案。

4、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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2020 年开始聘任德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金进行审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所审计费为人民币 3 万元。

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

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

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 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	
长江证券	1	16,782,547.94	46.78%	15,294.25	48.84%	-
国盛证券	1	7,453,056.33	20.77%	5,450.55	17.40%	-
西南证券	1	7,381,867.20	20.57%	6,874.74	21.95%	-
华安证券	1	3,234,478.96	9.02%	2,947.58	9.41%	-
东方财富证券	1	872,247.85	2.43%	637.82	2.04%	-
天风证券	1	154,210.08	0.43%	112.76	0.36%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对交易单元租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本报告期新增交易单元：财通证券 49787，南京证券 49825，德邦证券 50643；本报告期退租交易单元：无。

### 11.7.2 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
长江证券	40,863,675.28	43.24%	-	-	-	-
国盛证券	6,781,656.90	7.18%	400,000.00	0.24%	-	-
西南证券	36,355,336.30	38.47%	155,000,000.00	92.76%	-	-
华安证券	6,086,690.88	6.44%	-	-	-	-
东方财富证券	3,937,068.10	4.17%	8,700,000.00	5.21%	-	-
天风证券	326,958.78	0.35%	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-



瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	157,621.00	0.17%	3,000,000.00	1.80%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》及规定网站	2021年1月13日
2	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1月18日
3	泰信基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国金证券基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021年1月19日

4	2020 年 4 季度报告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 1 月 21 日
5	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
6	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
7	关于泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理变更的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 2 月 1 日
8	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 2 月 4 日
9	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
10	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
11	关于旗下基金参与盈米基金转换费率优惠的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 3 月 25 日
12	2020 年年度报告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 3 月 29 日
13	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	《中国证券报》及规定网站	2021 年 4 月 1 日
14	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
15	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	《中国证券报》及规定网站	2021 年 4 月 1 日
16	关于调整部分销售渠道申赎、赎回下限公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 4 月 8 日
17	2021 年 1 季度报告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 4 月 20 日
18	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
19	部分基金在中航证券有限公司开通转换业务的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 7 月 9 日
20	新增上海爱建基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务及参加其费率优惠	《中国证券报》及规定网站	2021 年 7 月 12 日
21	关于新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构并开通定投、转换及费率优惠业务的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 7 月 16 日
22	关于根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修订旗	《中国证券报》及规定网站	2021 年 7 月 19 日

	下部分基金法律文件的公告		
23	2021 年 2 季度报告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 7 月 20 日
24	关于旗下部分基金参加盈米基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 7 月 22 日
25	关于旗下部分基金在招商证券股份有限公司开通定投并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 7 月 31 日
26	关于旗下部分基金参加基金销售机构费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 8 月 4 日
27	关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 8 月 25 日
28	2021 年中期报告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 8 月 28 日
29	旗下部分开放式基金新增度小满基金为销售机构，开通转换、定投业务并参加其费率优惠活动	《中国证券报》及规定网站	2021 年 9 月 3 日
30	关于在上海天天基金销售有限公司调整首次申购、追加申购及定投起点的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 9 月 9 日
31	关于旗下部分基金在海通证券股份有限公司参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 9 月 9 日
32	关于新增东方财富证券股份有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 9 月 27 日
33	泰信基金管理有限公司关于股权变更的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 9 月 28 日
34	2021 年第 3 季度报告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 10 月 26 日
35	在上海基煜基金销售有限公司调整申购、赎回业务起点及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 11 月 3 日
36	新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 12 月 8 日
37	在浙江同花顺基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司申购、定期定额投资、转换业务起点并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021 年 12 月 9 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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 - 20210428	22,562,291.54	-	22,562,291.54	-	-
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>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等相关法律法规的规定及本基金基金合同相关约定，经与本基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，泰信基金管理有限公司决定对泰信鑫利混合型证券投资基金增加侧袋机制相关内容，并对基金合同等法律文件进行修订。本次修订自 2021 年 7 月 19 日起正式生效。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信鑫利混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信鑫利混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信鑫利混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信鑫利混合型证券投资基金托管协议》
- 5、中国证监会批准设立泰信基金管理有限公司的文件
- 6、报告期内泰信鑫利混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 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

2022年3月29日