

# 泰信鑫利混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 26 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 2022 年 8 月 25 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>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 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 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       | 16        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16        |
| 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 | 16        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见       | 16        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 17        |
| 6.2 利润表                                 | 18        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 20        |
| 6.4 报表附注                                | 23        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>41</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 41        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 41        |
| 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       | 42        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 42        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 43        |
| 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      | 43        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 43        |
| 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 ..... | 44        |
| 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 .....    | 44        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 44        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 44        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 44        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 45        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 45        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 45        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>46</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 46        |
| 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 .....      | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 47        |
| 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 .....         | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 47        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 49        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>50</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 50        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 51        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>51</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 51        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 51        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 51        |

## § 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      | 2,480,464.99 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 | 1,317,615.10 份  | 1,162,849.89 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<br>负责人 | 姓名                           | 罗丽娟             |
|             | 联系电话                         | 021-20899098    |
|             | 电子邮箱                         | xxpl@ftfund.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 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 | 李高峰                             | 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 | <a href="http://www.ftfund.com">http://www.ftfund.com</a> |
| 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）自由贸易实验区浦东南路 256 号 36、37 层 |
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼        |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022年01月01日-2022年06月30日) |              |              |
|---------------|------------------------------|--------------|--------------|
|               | 泰信鑫利混合 A                     | 泰信鑫利混合 C     |              |
| 本期已实现收益       | -53,951.22                   | -62,069.04   |              |
| 本期利润          | -135,837.76                  | -129,039.25  |              |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1003                      | -0.0974      |              |
| 本期加权平均净值利润率   | -8.52%                       | -8.44%       |              |
| 本期基金份额净值增长率   | -5.88%                       | -6.07%       |              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022年6月30日)             |              |              |
|               | 期末可供分配利润                     | -1,875.24    | -25,426.85   |
|               | 期末可供分配基金份额利润                 | -0.0014      | -0.0219      |
|               | 期末基金资产净值                     | 1,633,806.05 | 1,413,563.53 |

|              |                  |        |
|--------------|------------------|--------|
| 值            |                  |        |
| 期末基金份额净值     | 1.2400           | 1.2156 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022年6月30日) |        |
| 基金份额累计净值增长率  | 24.00%           | 21.56% |

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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 9.13%    | 1.49%       | 2.80%      | 0.32%         | 6.33%  | 1.17% |
| 过去三个月      | 7.82%    | 1.65%       | 2.75%      | 0.42%         | 5.07%  | 1.23% |
| 过去六个月      | -5.88%   | 1.63%       | -1.31%     | 0.44%         | -4.57% | 1.19% |
| 过去一年       | 16.45%   | 1.60%       | -0.61%     | 0.37%         | 17.06% | 1.23% |
| 过去三年       | 16.99%   | 1.04%       | 16.48%     | 0.37%         | 0.51%  | 0.67% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.00%   | 0.79%       | 31.88%     | 0.37%         | -7.88% | 0.42% |

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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

|                |        |       |        | ④     |         |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去一个月          | 9.09%  | 1.49% | 2.80%  | 0.32% | 6.29%   | 1.17% |
| 过去三个月          | 7.71%  | 1.65% | 2.75%  | 0.42% | 4.96%   | 1.23% |
| 过去六个月          | -6.07% | 1.63% | -1.31% | 0.44% | -4.76%  | 1.19% |
| 过去一年           | 15.98% | 1.60% | -0.61% | 0.37% | 16.59%  | 1.23% |
| 过去三年           | 15.60% | 1.04% | 16.48% | 0.37% | -0.88%  | 0.67% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 21.56% | 0.79% | 31.88% | 0.37% | -10.32% | 0.42% |

注：沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%

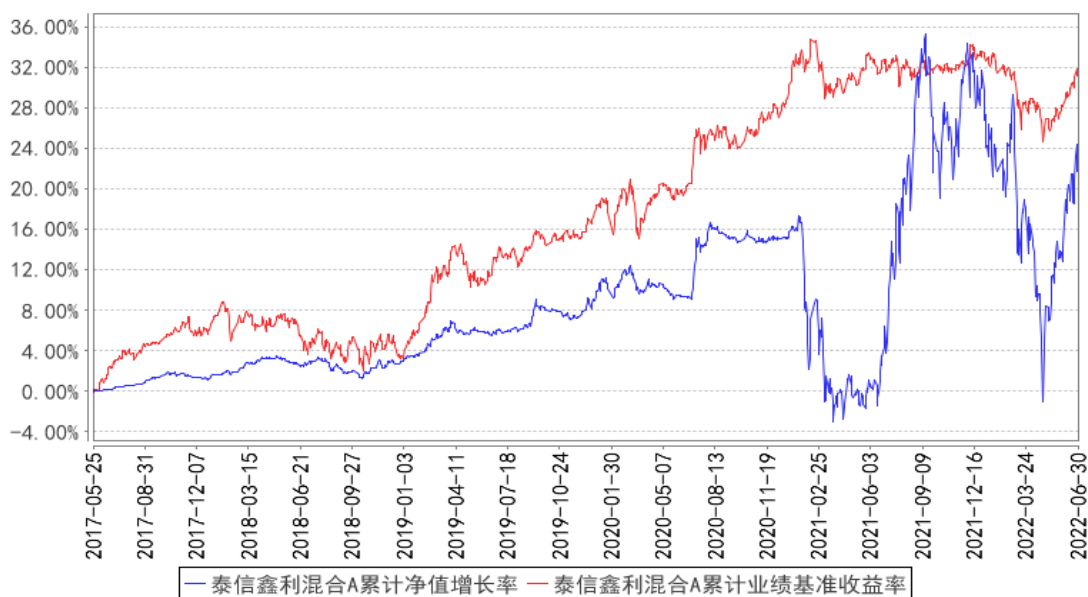
1、沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本的综合性指数；样本选择标准为规模大、流动性好的股票，目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。

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。

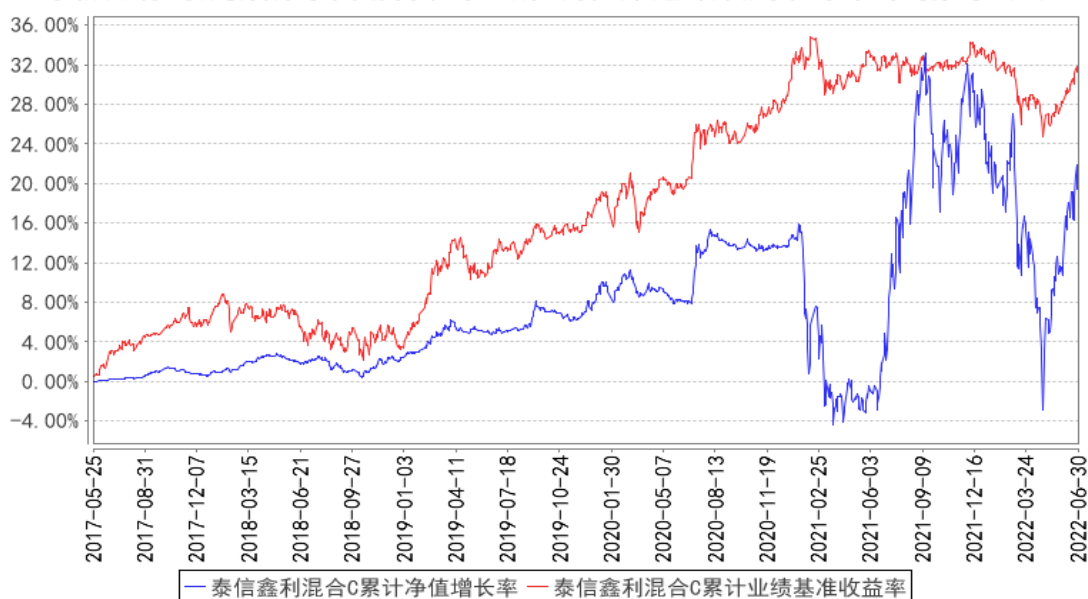


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰信鑫利混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰信鑫利混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 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%；基金持有全部权证的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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：李高峰

总经理：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。2021 年 9 月 2 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]2848 号文核准，山东省国际信托股份有限公司将其持有的 45%股权转让给山东省鲁信投资控股集团有限公司。目前，公司注册资本为 2 亿元人民币，股东为山东省鲁信投资控股集团有限公司、江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司。

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 2022 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 2022 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、泰信智选成长混合、泰信鑫利混合、泰信竞争优势混合、泰信景气驱动 12 个月持有期混合、泰信汇享利率债债券、泰信低碳经济混合发起式、泰信均衡价值混合、泰信汇利三个月定开债券、泰信医疗服务混合发起式、泰信添利 30 天持有期债券发起式、泰信鑫瑞债券发起式、泰信汇盈债券共 30 只开放式基金及 39 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 |        |  |
| 郑宇光 | 固收投资部 副 总 监、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，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、泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理。 | 2021 年 1 月 13 日 | -    | 17 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 2022 年 5 月任泰信双债增利债券型证券投资基金（于 2022 年 5 月 19 日进入清算程序）基金经理，2022 年 3 月任泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理。 |

|     |   |                |   |     |  |
|-----|---|----------------|---|-----|--|
| 张安格 | 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、泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理、泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理、泰信汇盈债券型证券投资基金基金经理。 | 2021 年 2 月 1 日 | - | 7 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，2022 年 3 月任泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 3 月任泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 3 月任泰信汇盈债券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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信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

上半年国内经济基本面波动较大，下行压力增加。年初 1-2 月经济数据比较强劲，基本实现了总量开门红效应，但是从高频数据来看，经济恢复的持续性有待验证。进入 3 月以后，疫情对经济的扰动明显增大。尤其是 4-5 月上海的全域静态管理使得市场对经济的悲观预期进一步发酵。由于上海在众多高新技术产业领域具有重要的资源调配和供应链管理地位，因此上海疫情期间，很多原本处于景气上行的高新技术产业出现了供应链压力。受疫情影响，二季度经济出现明显下滑，一二季度 GDP 当季同比增速分别为 4.8% 和 0.4%。但是从高频数据、5-6 月份的金融数据来看，随着疫情的缓解，经济基本面在企稳并恢复。只要疫情形势稳定，基本可以确认经济底就出现在二季度，未来经济虽可能会有波动，但总体是恢复向好的趋势。

伴随经济的波动，权益市场在上半年也经历了较大的波动。年初市场着重博弈稳增长板块，更看重的是稳增长政策下一些困境企业的业绩预期改善，但对于依靠自身行业景气度和供需格局改善的基本面确定性较高的成长标的却存在畏高、急于兑现收益的情况。这导致市场主要的交易逻辑与基本面之间难以建立令人信服的联系，一些基本面强劲的企业也遭遇股价大幅下挫，不禁引发投资者对大熊市要来的恐慌。所以到了 4 月份，股市在经历一季度下跌之后，又迎来更深一波的快速下探，且呈现出泥沙俱下的状态。直至 4 月末，政治局会议给市场带来一些信心，A 股

止跌企稳。5-6 月，以光伏、新能源车、锂电为代表的成长性板块引领权益市场反弹，此外大消费也明显回暖。这轮上涨行情除了具有超跌反弹本身的逻辑，还在于我们看到一些成长性企业在经历经济基本面波动的情况下依旧经营业绩稳健向上，具备一定的穿越经济周期的能力，而其估值在经历过一季度的下跌之后，性价比已到了具有吸引力的位置。另外疫情的缓和使得投资者对经济底有了确认，市场开始从交易稳增长政策转向交易经济复苏后的相关产业链盈利改善。整体上看，这一轮的反弹与基本面情况更契合。

债券方面，上半年看似发生了一些超预期的事件，但是债券收益率的波动始终控制在一个较窄的区间。从中债估值来看，上半年 10 年期国债收益率绝大部分时间在 2.70-2.85%之间波动，市场始终围绕经济数据、政策利率和疫情走势做多重博弈，极致博弈的结果反而会熨平一部分波动。确实上半年债市利空和利多因素交织。经济逐步企稳恢复、通胀压力有所抬升、房地产政策边际放松、外围加息都使债券收益率有上行动能。但是宽松的资金面及机构旺盛的配置需求在一定程度上又限制了债券收益率的上行空间。所以在多空因素的角力之下，债券市场总体呈现窄幅波动的状态。

上半年，本基金在股票和可转债上的配置比例先降后升，持仓仍主要集中在景气度较高的新能源车、光伏及其相关产业链标的上。

#### 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 1.2400 元，本报告期基金份额净值增长率为 -5.88%；截至本报告期末泰信鑫利混合 C 基金份额净值为 1.2156 元，本报告期基金份额净值增长率为 -6.07%；同期业绩比较基准收益率为 -1.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年，我们认为权益市场存在结构性机会，债券市场则需警惕收益率上行风险。

权益方面，经过二季度的上涨，需要重新再审视一下各类标的的估值合理性。从 4 月底以来的 A 股反弹相对比较顺畅，除了超跌反弹本身的逻辑，还有一个原因是在一季度大跌的过程中很多权益基金的仓位已降至历史较低位置，所以在这轮反弹中抛盘会比较少。但是经过五六月份的反弹，一些权益基金的仓位已经提高，后续存在获利了结回归均衡仓位的动力。同时，也有一部分还没来得及补仓的投资者可能会急于寻找可加仓的标的。无论是前者还是后者，从理性的角度来说都会更加重视对标的估值的思考和对比，会考量标的估值是否有基本面的支持。所以，未来一段时间权益市场的结构性行情可能会更加极致。随着半年报的陆续披露，届时市场可能会存在一个去伪存真的过程。另外，需要重新思考一些受疫情或者产业政策影响较大的领域是否存在商业模式的改变。部分疫情受损企业的市值已经接近甚至超过疫情前，但是所面临的经营环境却

是今非昔比，只要动态清零的政策不变，这类企业就始终要面临经营的重大不确定性。所以，接下来更需要静下心来想一想疫情过后各个行业的经营模式和竞争格局是不是有变化，而不是简单的博弈困境反转逻辑。综合来看，我们认为成长和周期成长型企业能够穿越经济周期最终为股东带来较好的回报。我们更愿意在具有  $\beta$  机会的领域里寻找  $\alpha$ ，在需求强劲、政策支持领域去寻找技术壁垒较高、竞争格局稳定，能够受益于供需关系的企业。

债券方面，应重点关注两个方面：（1）资金面。很显然，当前的资金水平已偏离政策利率水平。未来隔夜和 7D 的利率水平一定会回归政策利率附近，只不过是回升的速度和步伐有待观察。目前我们的判断是，资金利率水平会逐级抬升，而非跳跃式调整。原因在于经济的复苏还不够稳固，需要一段时间来检验经济恢复的力度和持续性，因此在确认经济稳中向好之前，不会贸然收紧流动性。另外，“宽信用、降低企业融资成本”是贯穿今年全年的重要工作，需要宽松的资金面配合。（2）经济走势。经济恢复趋势的确立意味着债市难言有大的机会，而经济恢复的斜率决定了债市调整的上限。在终端需求并未完全恢复、房地产对经济拉动效应消失，以及“不会出台超大规模刺激政策”的背景下，经济大概率会呈现的是“温和复苏”的状态，大超预期的可能性并不大。所以从经济基本面角度来说，不会对债券市场形成巨大的调整压力，即使债券收益率上行，但幅度不会很大。综上所述，未来一段时间内，债券投资应适当缩短久期，短期内杠杆策略优于久期策略，对于波段交易，需要严格执行交易纪律，不可贪多，及时止盈止损。

#### 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

##### 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。

2、本报告期本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 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：泰信鑫利混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 647,796.47                     | 109,944.65                       |
| 结算备付金         |            | -                              | 25,575.32                        |
| 存出保证金         |            | 528.17                         | 499.44                           |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 2,542,220.50                   | 3,804,279.26                     |
| 其中：股票投资       |            | 814,086.58                     | 1,141,713.26                     |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 1,728,133.92                   | 2,662,566.00                     |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                              | 200,000.00                       |
| 债权投资          |            | -                              | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        |            | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      |            | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | -                              | 100,129.86                       |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 2,599.64                       | 7,243.89                         |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | 3,686.93                         |
| 资产总计          |            | 3,193,144.78                   | 4,251,359.35                     |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2021 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        |            | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                              | -                                |
| 应付清算款         |            | 126,747.21                     | 84,007.45                        |
| 应付赎回款         |            | -                              | 55,914.31                        |

|             |         |              |              |
|-------------|---------|--------------|--------------|
| 应付管理人报酬     |         | 2,904.15     | 4,330.84     |
| 应付托管费       |         | 484.04       | 721.80       |
| 应付销售服务费     |         | 460.32       | 720.67       |
| 应付投资顾问费     |         | -            | -            |
| 应交税费        |         | 12.62        | 16.96        |
| 应付利润        |         | -            | -            |
| 递延所得税负债     |         | -            | -            |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 15,166.86    | 30,998.22    |
| 负债合计        |         | 145,775.20   | 176,710.25   |
| <b>净资产：</b> |         |              |              |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 2,480,464.99 | 3,118,325.25 |
| 其他综合收益      |         | -            | -            |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 566,904.59   | 956,323.85   |
| 净资产合计       |         | 3,047,369.58 | 4,074,649.10 |
| 负债和净资产总计    |         | 3,193,144.78 | 4,251,359.35 |

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,480,464.99 份，其中泰信鑫利混合 A 基金份额净值人民币 1.2400 元，份额总额 1,317,615.10 份；泰信鑫利混合 C 基金份额净值人民币 1.2156 元，份额总额 1,162,849.89 份。

2、以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：泰信鑫利混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目             | 附注号     | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|---------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b> |         | -205,441.45                              | -3,116,426.92                                 |
| 1. 利息收入        |         | 3,317.97                                 | 57,877.98                                     |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.9 | 1,194.74                                 | 5,028.73                                      |
| 债券利息收入         |         | -  | 42,889.40                                     |
| 资产支持证券利息收入     |         | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入     |         | 2,123.23                                 | 9,959.85                                      |
| 证券出借利息收入       |         | -  | -   |

|                            |            |             |               |
|----------------------------|------------|-------------|---------------|
| 其他利息收入                     |            | -           | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | -63,886.93  | -3,123,950.69 |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.10   | -119,102.90 | -563,938.43   |
| 基金投资收益                     |            | -           | -             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.11   | 53,103.30   | -2,560,250.26 |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.12   | -           | -             |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.13   | -           | -             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14   | -           | -             |
| 股利收益                       | 6.4.7.15   | 2,112.67    | 238.00        |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -           | -             |
| 其他投资收益                     |            | -           | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.16   | -148,856.75 | -50,697.47    |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -           | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.17   | 3,984.26    | 343.26        |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 59,435.56   | 244,860.01    |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 18,637.60   | 98,634.18     |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 3,106.30    | 16,439.03     |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 3,041.79    | 31,500.37     |
| 4. 投资顾问费                   |            | -           | -             |
| 5. 利息支出                    |            | -           | 8,460.02      |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -           | 8,460.02      |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.18   | -           | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | 8.48        | 40.22         |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.19   | 34,641.39   | 89,786.19     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -264,877.01 | -3,361,286.93 |
| 减：所得税费用                    |            | -           | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -264,877.01 | -3,361,286.93 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -           | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -264,877.01 | -3,361,286.93 |

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示；2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”

金额。

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |             |               |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|-------------|---------------|
|                                     | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润       | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                     | 3,118,325.25                          | -      | 956,323.85  | 4,074,649.10  |
| 加：会计政策变更                            | -                                     | -      | -           | -             |
| 前期差错更正                              | -                                     | -      | -           | -             |
| 其他                                  | -                                     | -      | -           | -             |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                     | 3,118,325.25                          | -      | 956,323.85  | 4,074,649.10  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -637,860.26                           | -      | -389,419.26 | -1,027,279.52 |
| (一)、综合收益总额                          | -                                     | -      | -264,877.01 | -264,877.01   |
| (二)、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) | -637,860.26                           | -      | -124,542.25 | -762,402.51   |

|  |                                 |        |              |               |
|--|---------------------------------|--------|--------------|---------------|
| 其中:1.<br>基金申购款   | 452,638.63                      | -      | 81,630.56    | 534,269.19    |
| 2<br>.基金赎回款  | -1,090,498.89                   | -      | -206,172.81  | -1,296,671.70 |
| (三)、<br>本期向<br>基金份额<br>持有人分配<br>利润产生<br>的基金净<br>值变动(净<br>值减少以<br>“-”号填<br>列) | -                               | -      | -            | -             |
| (四)、<br>其他综合<br>收益结转<br>留存收益   | -                               | -      | -            | -             |
| 四、本期<br>期末净资<br>产(基金净<br>值)  | 2,480,464.99                    | -      | 566,904.59   | 3,047,369.58  |
| 项目   | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |        |              |               |
|  | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润        | 净资产合计         |
| 一、上期<br>期末净资<br>产(基金净<br>值)  | 23,549,449.97                   | -      | 3,355,129.80 | 26,904,579.77 |
| 加:会计<br>政策变更   | -                               | -      | -            | -             |
| 前期差<br>错更正   | -                               | -      | -            | -             |
| 其他   | -                               | -      | -            | -             |
| 二、本期<br>期初净资<br>产(基  | 23,549,449.97                   | -      | 3,355,129.80 | 26,904,579.77 |

|  |                |   |               |                |
|--|----------------|---|---------------|----------------|
| 金净值)   |                |   |               |                |
| 三、本期<br>增减变动额(减少以“-”<br>号填列)                                     | -22,262,693.44 | - | -3,281,816.44 | -25,544,509.88 |
| (一)、<br>综合收益总额   | -              | - | -3,361,286.93 | -3,361,286.93  |
| (二)、<br>本期基金份额<br>交易产生的基金<br>净值变动数<br>(净值减少以<br>“-”号填列)          | -22,262,693.44 | - | 79,470.49     | -22,183,222.95 |
| 其中:1.<br>基金申购款   | 534,025.07     | - | 3,683.09      | 537,708.16     |
| 2<br>.基金赎回款  | -22,796,718.51 | - | 75,787.40     | -22,720,931.11 |
| (三)、<br>本期向基金份<br>额持有人分配<br>利润产生的基<br>金净值变动(净<br>值减少以“-”<br>号填列) | -              | - | -             | -              |
| (四)、<br>其他综合收益<br>结转留存收益   | -              | - | -             | -              |
| 四、本期<br>期末净  | 1,286,756.53   | - | 73,313.36     | 1,360,069.89   |

|          |  |  |  |  |
|----------|--|--|--|--|
| 资产(基金净值) |  |  |  |  |
|----------|--|--|--|--|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| <u>高宇</u> | <u>叶振宇</u> | <u>叶振宇</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人    |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰信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%。

#### 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 上半年的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下简称“新金融工具准则”)相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号)，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用新金融工具准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息，金额分别为人民币 109,944.65 元、人民币 25,575.32 元、人民币



499.44 元、人民币 200,000.00 元、人民币-54.83 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息的金额分别为人民币 109,975.41 元、人民币 25,586.82 元、人民币 499.74 元、人民币 199,902.61 元、人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 3,804,279.26 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 3,741.76 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 3,808,021.02 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年6月30日 |
|---------------|-------------------|
| 活期存款          | 647,796.47        |
| 等于: 本金        | 647,731.38        |
| 加: 应计利息       | 65.09             |
| 减: 坏账准备       | -                 |
| 定期存款          | -                 |
| 等于: 本金        | -                 |
| 加: 应计利息       | -                 |
| 减: 坏账准备       | -                 |
| 其中: 存款期限1个月以内 | -                 |
| 存款期限1-3个月     | -                 |
| 存款期限3个月以上     | -                 |
| 其他存款          | -                 |
| 等于: 本金        | -                 |
| 加: 应计利息       | -                 |
| 减: 坏账准备       | -                 |
| 合计            | 647,796.47        |

注: 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022年6月30日 |
|----|-------------------|
|----|-------------------|

|               |       | 成本           | 应计利息     | 公允价值         | 公允价值变动     |
|---------------|-------|--------------|----------|--------------|------------|
| 股票            |       | 817,146.72   | -        | 814,086.58   | -3,060.14  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -            | -        | -            | -          |
| 债券            | 交易所市场 | 1,616,519.53 | 4,746.22 | 1,728,133.92 | 106,868.17 |
|               | 银行间市场 | -            | -        | -            | -          |
|               | 合计    | 1,616,519.53 | 4,746.22 | 1,728,133.92 | 106,868.17 |
| 资产支持证券        |       | -            | -        | -            | -          |
| 基金            |       | -            | -        | -            | -          |
| 其他            |       | -            | -        | -            | -          |
| 合计            |       | 2,433,666.25 | 4,746.22 | 2,542,220.50 | 103,808.03 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 290.47            |
| 其中：交易所市场    | 290.47            |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 14,876.39         |
| 合计          | 15,166.86         |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 泰信鑫利混合 A

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |              |
|---------------|----------------------------|--------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额         |
| 上年度末          | 1,664,999.90               | 1,664,999.90 |
| 本期申购          | 240,425.77                 | 240,425.77   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -587,810.57                | -587,810.57  |
| 基金拆分/份额折算前    | -                          | -            |

|               |              |              |
|---------------|--------------|--------------|
| 基金拆分/份额折算调整   | -            | -            |
| 本期申购          | -            | -            |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -            | -            |
| 本期末           | 1,317,615.10 | 1,317,615.10 |

## 泰信鑫利混合 C

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |              |
|---------------|---------------------------------------|--------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额         |
| 上年度末          | 1,453,325.35                          | 1,453,325.35 |
| 本期申购          | 212,212.86                            | 212,212.86   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -502,688.32                           | -502,688.32  |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -            |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -            |
| 本期申购          | -                                     | -            |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -            |
| 本期末           | 1,162,849.89                          | 1,162,849.89 |

注：申购含红利再投、转换入及份额级别调增数，赎回含转换出及份额级别调减数。

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

## 泰信鑫利混合 A

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分      | 未分配利润合计     |
|----------------|------------|------------|-------------|
| 本期期初           | 76,911.88  | 451,807.94 | 528,719.82  |
| 本期利润           | -53,951.22 | -81,886.54 | -135,837.76 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -24,835.90 | -51,855.21 | -76,691.11  |
| 其中：基金申购款       | 9,510.37   | 39,876.44  | 49,386.81   |
| 基金赎回款          | -34,346.27 | -91,731.65 | -126,077.92 |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -           |
| 本期末            | -1,875.24  | 318,066.19 | 316,190.95  |

## 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     |
|----------------|------------|------------|-------------|
| 本期期初           | 39,437.52  | 388,166.51 | 427,604.03  |
| 本期利润           | -62,069.04 | -66,970.21 | -129,039.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,795.33  | -45,055.81 | -47,851.14  |
| 其中：基金申购款       | 3,034.67   | 29,209.08  | 32,243.75   |
| 基金赎回款          | -5,830.00  | -74,264.89 | -80,094.89  |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -           |
| 本期末            | -25,426.85 | 276,140.49 | 250,713.64  |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 活期存款利息收入  | 980.25               |
| 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 | 210.76               |
| 其他        | 3.73                 |
| 合计        | 1,194.74             |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                   |
|------------------|----------------------|
|                  | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -119,102.90          |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                    |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                    |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                    |
| 合计               | -119,102.90          |

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 687,928.40           |
| 减：卖出股票成本总额 | 805,186.92           |
| 减：交易费用     | 1,844.38             |
| 买卖股票差价收入   | -119,102.90          |

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                   |
|------------------------------|----------------------|
|                              | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 3,753.03             |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 49,350.27            |
| 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                           | 53,103.30            |

## 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 4,389,804.63               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,335,708.26               |
| 减：应计利息总额               | 4,613.21                   |
| 减：交易费用                 | 132.89                     |
| 买卖债券差价收入               | 49,350.27                  |

## 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

## 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 2,112.67                   |
| 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            | 2,112.67                   |

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -148,856.75                |
| 股票投资       | 15,328.24                  |
| 债券投资       | -164,184.99                |
| 资产支持证券投资   | -                          |
| 基金投资       | -                          |
| 贵金属投资      | -                          |
| 其他         | -                          |
| 2. 衍生工具    | -                          |
| 权证投资       | -                          |
| 3. 其他      | -                          |

|                        |             |
|------------------------|-------------|
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -           |
| 合计                     | -148,856.75 |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 3,984.26                   |
| 合计      | 3,984.26                   |

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

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

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 14,876.39                  |
| 信息披露费   | -                          |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行费用    | 1,165.00                   |
| 账户维护费   | 18,000.00                  |
| 其他      | 600.00                     |
| 合计      | 34,641.39                  |

### 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(“泰信基金管理<br>有限公司”) | 基金管理人     |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)           | 基金托管人     |
| 山东省鲁信投资控股集团有限公司              | 基金管理人的股东  |
| 江苏省投资管理有限责任公司                | 基金管理人的股东  |
| 青岛国信实业有限公司                   | 基金管理人的股东  |
| 上海锐懿资产管理有限公司                 | 基金管理人的子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年1月1日至2022年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 18,637.60                      | 98,634.18                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4,847.98                       | 2,427.88                            |

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。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年 |
|----|------------------------|----------------------------|
|----|------------------------|----------------------------|



|                | 月 30 日   | 6 月 30 日  |
|----------------|----------|-----------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,106.30 | 16,439.03 |

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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     | -  | 0.26      | 0.26      |
| 中国银行           | -  | 455.33    | 455.33    |
| 合计             | -  | 455.59    | 455.59    |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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     | -  | 30,575.60 | 30,575.60 |
| 中国银行           | -  | 50.52     | 50.52     |
| 合计             | -  | 30,626.12 | 30,626.12 |

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |        | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021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  | 647,796.47                 | 980.25 | 81,224.35                       | 3,157.53 |

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**

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内无利润分配的情况。

**6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

本基金本报告期末无从事正回购交易作为抵押的债券。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

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

**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，

并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设审计、合规与风险控制委员会、督察长、监察稽核部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、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 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 156,031.20             | -                        |
| 合计     | 156,031.20             | -                        |

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 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。

##### 6.4.13.2.3 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。

##### 6.4.13.2.4 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<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
|--------|------------------------|--------------------------|

|        |              |              |
|--------|--------------|--------------|
| AAA    | 68,940.00    | -            |
| AAA 以下 | 1,498,416.50 | 2,506,800.00 |
| 未评级    | -            | -            |
| 合计     | 1,567,356.50 | 2,506,800.00 |

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。

#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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 2022 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为人民币 3,187,805.30 元，超过经确认的当日净赎回金额。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资。利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022 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                   | 647,796.47   | -     | -         | -          | 647,796.47   |
| 存出保证金                  | 528.17       | -     | -         | -          | 528.17       |
| 交易性金融资产                | 1,669,054.19 | -     | 59,079.73 | 814,086.58 | 2,542,220.50 |

|                          |              |              |            |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| 应收申购款                    | -            | -            | -          | 2,599.64     | 2,599.64     |
| 资产总计                     | 2,317,378.83 | -            | 59,079.73  | 816,686.22   | 3,193,144.78 |
| 负债                       |              |              |            |              |              |
| 应付管理人报酬                  | -            | -            | -          | 2,904.15     | 2,904.15     |
| 应付托管费                    | -            | -            | -          | 484.04       | 484.04       |
| 应付清算款                    | -            | -            | -          | 126,747.21   | 126,747.21   |
| 应付销售服务费                  | -            | -            | -          | 460.32       | 460.32       |
| 应交税费                     | -            | -            | -          | 12.62        | 12.62        |
| 其他负债                     | -            | -            | -          | 15,166.86    | 15,166.86    |
| 负债总计                     | -            | -            | -          | 145,775.20   | 145,775.20   |
| 利率敏感度缺口                  | 2,317,378.83 | -            | 59,079.73  | 670,911.02   | 3,047,369.58 |
| 上年度末<br>2021 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                     | 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 |
| 负债                       |              |              |            |              |              |
| 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 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                 |                             |                |
|----|---------------------------------|-----------------------------|----------------|
| 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(2022年6月30日)             | 上年度末(2021年12月) |

|                  |  |        |            |
|------------------|--|--------|------------|
|                  |  |        | 31 日 )     |
| 1. 市场利率上升 25 个基点 |  | -23.76 | -27,396.83 |
| 2. 市场利率下降 25 个基点 |  | 23.77  | 27,926.61  |

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年6月30日 |               | 上年度末<br>2021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  | 814,086.58        | 26.71         | 1,141,713.26        | 28.02         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                 | -             | -                   | -             |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                 | -             | -                   | -             |
| 其他            | -                 | -             | -                   | -             |
| 合计            | 814,086.58        | 26.71         | 1,141,713.26        | 28.02         |

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

|                |                       |                             |                   |
|----------------|-----------------------|-----------------------------|-------------------|
| 假设             | 本基金业绩比较基准变化 5%，其他变量不变 |                             |                   |
| 分析             | 相关风险变量的变动             | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|                |                       | 本期末（2022年6月30日）             | 上年度末（2021年12月31日） |
|                | 1. 业绩比较基准上升 5%        | 462,986.86                  | 406,596.24        |
| 2. 业绩比较基准下降 5% | -462,986.86           | -406,596.24                 |                   |

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 2,383,248.81      | 3,648,513.26        |
| 第二层次          | 158,971.69        | 155,766.00          |
| 第三层次          | -                 | -                   |
| 合计            | 2,542,220.50      | 3,804,279.26        |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额           | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|--------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 814,086.58   | 25.49         |
|    | 其中：股票             | 814,086.58   | 25.49         |
| 2  | 基金投资              | -            | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,728,133.92 | 54.12         |
|    | 其中：债券             | 1,728,133.92 | 54.12         |
|    | 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      | 647,796.47   | 20.29         |
| 8  | 其他各项资产            | 3,127.81     | 0.10          |
| 9  | 合计                | 3,193,144.78 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -             |
| B  | 采矿业              | -          | -             |
| C  | 制造业              | 814,086.58 | 26.71         |
| 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              | -          | -             |
| 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        | 814,086.58 | 26.71 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 002460 | 赣锋锂业 | 1,200 | 178,440.00 | 5.86         |
| 2  | 600522 | 中天科技 | 7,007 | 161,861.70 | 5.31         |
| 3  | 600111 | 北方稀土 | 3,000 | 105,480.00 | 3.46         |
| 4  | 002240 | 盛新锂能 | 1,500 | 90,540.00  | 2.97         |
| 5  | 300568 | 星源材质 | 2,997 | 87,032.88  | 2.86         |
| 6  | 688077 | 大地熊  | 800   | 67,448.00  | 2.21         |
| 7  | 002466 | 天齐锂业 | 500   | 62,400.00  | 2.05         |
| 8  | 002756 | 永兴材料 | 400   | 60,884.00  | 2.00         |

### 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  | 002466 | 天齐锂业 | 141,982.00 | 3.48           |
| 2  | 000792 | 盐湖股份 | 84,950.00  | 2.08           |
| 3  | 002240 | 盛新锂能 | 84,600.00  | 2.08           |
| 4  | 688077 | 大地熊  | 72,912.00  | 1.79           |
| 5  | 002756 | 永兴材料 | 59,788.00  | 1.47           |
| 6  | 300568 | 星源材质 | 18,000.00  | 0.44           |

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  | 002466 | 天齐锂业 | 120,379.00 | 2.95           |
| 2  | 600110 | 诺德股份 | 87,060.00  | 2.14           |
| 3  | 300748 | 金力永磁 | 79,789.15  | 1.96           |
| 4  | 688198 | 佰仁医疗 | 76,400.00  | 1.88           |
| 5  | 000792 | 盐湖股份 | 73,500.00  | 1.80           |
| 6  | 300207 | 欣旺达  | 72,487.00  | 1.78           |

|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 7  | 300568 | 星源材质 | 61,146.75 | 1.50 |
| 8  | 603678 | 火炬电子 | 48,806.50 | 1.20 |
| 9  | 002413 | 雷科防务 | 41,340.00 | 1.01 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 27,020.00 | 0.66 |

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 | 462,232.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 687,928.40 |

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 158,971.69   | 5.22         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,569,162.23 | 51.49        |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 1,728,133.92 | 56.71        |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张） | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-------|------------|--------------|
| 1  | 128111 | 中矿转债     | 350   | 298,403.91 | 9.79         |
| 2  | 128095 | 恩捷转债     | 550   | 238,164.77 | 7.82         |
| 3  | 128017 | 金禾转债     | 700   | 160,492.93 | 5.27         |
| 4  | 019658 | 21 国债 10 | 1,560 | 158,971.69 | 5.22         |
| 5  | 118000 | 嘉元转债     | 1,000 | 140,678.33 | 4.62         |

#### 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**

报告期末本基金未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

截至报告期末本基金未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

截至报告期末本基金未投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

截至报告期末本基金未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本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是否超出基金合同规定的备选股票库**

报告期内本基金投资的前十名股票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 | 528.17   |
| 2  | 应收清算款 | -        |
| 3  | 应收股利  | -        |
| 4  | 应收利息  | -        |
| 5  | 应收申购款 | 2,599.64 |
| 6  | 其他应收款 | -        |
| 7  | 待摊费用  | -        |
| 8  | 其他    | -        |
| 9  | 合计    | 3,127.81 |

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 128111 | 中矿转债 | 298,403.91 | 9.79         |
| 2  | 128095 | 恩捷转债 | 238,164.77 | 7.82         |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 3  | 128017 | 金禾转债 | 160,492.93 | 5.27 |
| 4  | 118000 | 嘉元转债 | 140,678.33 | 4.62 |
| 5  | 113025 | 明泰转债 | 137,075.84 | 4.50 |
| 6  | 128046 | 利尔转债 | 74,601.97  | 2.45 |
| 7  | 127043 | 川恒转债 | 69,577.27  | 2.28 |
| 8  | 113615 | 金诚转债 | 68,735.95  | 2.26 |
| 9  | 127038 | 国微转债 | 66,955.36  | 2.20 |
| 10 | 123121 | 帝尔转债 | 59,079.73  | 1.94 |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别     | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |            |              |            |
|----------|-----------|-----------|-------|------------|--------------|------------|
|          |           |           | 机构投资者 |            | 个人投资者        |            |
|          |           |           | 持有份额  | 占总份额比例 (%) | 持有份额         | 占总份额比例 (%) |
| 泰信鑫利混合 A | 132       | 9,981.93  | 0.00  | 0          | 1,317,615.10 | 100.00     |
| 泰信鑫利混合 C | 95        | 12,240.53 | 0.00  | 0          | 1,162,849.89 | 100.00     |
| 合计       | 227       | 10,927.16 | 0.00  | 0          | 2,480,464.99 | 100.00     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别     | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|----------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 泰信鑫利混合 A | 0.00       | 0.0000       |
|                  | 泰信鑫利混合 C | 0.00       | 0.0000       |
|                  | 合计       | 0.00       | 0.0000       |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                           | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------|----------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和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<br>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 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<br>(2017 年 5 月 25 日)<br>基金份额总额 | 204,735,499.79 | 254,452,284.93 |
| 本报告期期初基金份<br>额总额                       | 1,664,999.90   | 1,453,325.35   |
| 本报告期基金总申购<br>份额                        | 240,425.77     | 212,212.86     |
| 减：本报告期基金总<br>赎回份额                      | 587,810.57     | 502,688.32     |
| 本报告期基金拆分变<br>动份额                       | -              | -              |
| 本报告期期末基金份<br>额总额                       | 1,317,615.10   | 1,162,849.89   |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2022 年 4 月 26 日起，总经理高宇先生代任公司董事长职务，万众先生不再任公司董事长职务。具体详情参见 2022 年 4 月 28 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董事会审议通过，自 2022 年 6 月 30 日起，李高峰先生担任公司董事长职务，总经理高宇先生不再代任公司董事长职务。具体详情参见 2022 年 7 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董事长变更的公告》。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

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易       |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|--------|--------|------------|------------------|-----------|----------------|----|
|        |        | 成交金额       | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 方正证券   | 1      | 196,213.00 | 17.06            | 180.77    | 17.11          | -  |
| 安信证券   | 3      | 159,972.00 | 13.91            | 148.98    | 14.10          | -  |
| 东吴证券   | 2      | 152,737.00 | 13.28            | 139.18    | 13.18          | -  |
| 西南证券   | 1      | 152,226.50 | 13.24            | 141.77    | 13.42          | -  |
| 海通证券   | 3      | 140,935.90 | 12.25            | 128.45    | 12.16          | -  |
| 长江证券   | 1      | 126,290.00 | 10.98            | 115.09    | 10.89          | -  |
| 中银国际证券 | 3      | 120,379.00 | 10.47            | 109.70    | 10.38          | -  |
| 国金证券   | 1      | 101,407.00 | 8.82             | 92.42     | 8.75           | -  |
| 财通证券   | 1      | -          | -                | -         | -              | -  |
| 长城证券   | 1      | -          | -                | -         | -              | -  |
| 川财证券   | 1      | -          | -                | -         | -              | -  |
| 德邦证券   | 1      | -          | -                | -         | -              | -  |
| 东方证券   | 1      | -          | -                | -         | -              | -  |
| 光大证券   | 1      | -          | -                | -         | -              | -  |
| 广发证券   | 1      | -          | -                | -         | -              | -  |
| 广州证券   | 1      | -          | -                | -         | -              | -  |
| 国海证券   | 1      | -          | -                | -         | -              | -  |
| 国联证券   | 1      | -          | -                | -         | -              | -  |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 国盛证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安         | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 华金证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 开源证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 南京证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源         | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 万联证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 西藏东财         | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国中金<br>财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司         | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投         | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券         | 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：开源证券上海 54476，海通证券上海 54107，天风证券上海 53647；退租交易单元：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易         |                  | 债券回购交易        |                    | 权证交易 |                  |
|------|--------------|------------------|---------------|--------------------|------|------------------|
|      | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 方正证券 | 191,843.99   | 2.41             | -             | -                  | -    | -                |
| 安信证券 | 932,172.20   | 11.72            | 12,600,000.00 | 67.38              | -    | -                |
| 东吴证券 | 1,336,939.01 | 16.81            | -             | -                  | -    | -                |
| 西南证券 | 3,514,838.20 | 44.19            | 6,100,000.00  | 32.62              | -    | -                |



|              |            |      |   |   |   |   |
|--------------|------------|------|---|---|---|---|
| 海通证券         | 153,497.91 | 1.93 | - | - | - | - |
| 长江证券         | 707,906.54 | 8.90 | - | - | - | - |
| 中银国际<br>证券   | 93,900.00  | 1.18 | - | - | - | - |
| 国金证券         | 726,697.64 | 9.14 | - | - | - | - |
| 财通证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 长城证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 川财证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 德邦证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 东方证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 光大证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 广发证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 广州证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 国海证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 国联证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 国盛证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 国泰君安         | -          | -    | - | - | - | - |
| 国信证券         | 296,543.30 | 3.73 | - | - | - | - |
| 华安证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 华金证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 华泰证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 开源证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 南京证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 瑞银证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 申万宏源         | -          | -    | - | - | - | - |
| 天风证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 万联证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 西藏东财         | -          | -    | - | - | - | - |
| 招商证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 浙商证券         | -          | -    | - | - | - | - |
| 中国中金<br>财富证券 | -          | -    | - | - | - | - |
| 中金公司         | -          | -    | - | - | - | - |
| 中信建投         | -          | -    | - | - | - | - |
| 中信证券         | -          | -    | - | - | - | - |

### 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  | 关于旗下部分基金北京创金启富基金销 | 《中国证券报》、规定网站 | 2022年1月7日 |

|    |  |              |                 |
|----|--|--------------|-----------------|
|    | 售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告                                    |              |                 |
| 2  | 关于旗下部分基金新增奕丰基金销售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》、规定网站 | 2022 年 1 月 11 日 |
| 3  | 关于旗下部分基金在上海华夏财富投资管理有限公司开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告                        | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 1 月 17 日 |
| 4  | 2021 年第 4 季度报告   | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 1 月 24 日 |
| 5  | 关于旗下部分基金新增海银基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告                     | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 1 月 26 日 |
| 6  | 泰信鑫利混合基金更新招募说明书（2022 年 1 号）、产品资料概要更新                                     | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 3 月 11 日 |
| 7  | 关于旗下部分开放式基金参加国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告   | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 3 月 14 日 |
| 8  | 关于旗下部分开放式基金在北京创金启富基金销售有限公司参加其费率优惠活动的公告                                   | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 3 月 24 日 |
| 9  | 2021 年年度报告   | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 3 月 29 日 |
| 10 | 2022 年第 1 季度报告   | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 4 月 21 日 |
| 11 | 关于旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司费率优惠活动的公告  | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 4 月 28 日 |
| 12 | 关于基金行业高级管理人员变更的公告  | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 4 月 28 日 |
| 13 | 关于调整旗下部分基金在申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司申购、定期定额投资、赎回、转换业务起点金额（份额）并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 6 月 10 日 |
| 14 | 关于旗下部分开放式基金参加和讯科技费率优惠活动的公告   | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 6 月 21 日 |
| 15 | 关于调整旗下部分基金在华宝证券股份有限公司申购起点的公告   | 《中国证券报》、规定网站 | 2022 年 6 月 21 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信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、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、报告期内本基金在规定媒介对外披露的各项公告

### 12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。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。

### 12.3 查阅方式

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

泰信基金管理有限公司

2022年8月26日