

泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资 基金（LOF）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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	泰信基本面 400
场内简称	泰信 400
基金主代码	162907
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2012 年 9 月 7 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,855,786.47 份
基金合同存续期	不定期

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	罗丽娟	郭明
	联系电话	021-20899098	(010) 66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区浦	北京市西城区复兴门内大街 55

	东南路 256 号 36-37 层	号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李高峰	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
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 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	784,747.99
本期利润	-1,735,655.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0919
本期加权平均净值利润率	-7.66%
本期基金份额净值增长率	-6.46%
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	6,305,791.73
期末可供分配基金份额利润	0.5809
期末基金资产净值	13,437,329.46
期末基金份额净值	1.2378
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	4.37%

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

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

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

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.49%	0.99%	5.33%	0.95%	1.16%	0.04%
过去三个月	3.24%	1.59%	2.00%	1.59%	1.24%	0.00%
过去六个月	-6.46%	1.52%	-7.27%	1.53%	0.81%	-0.01%
过去一年	0.74%	1.27%	0.08%	1.29%	0.66%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.37%	1.19%	1.97%	1.19%	2.40%	0.00%

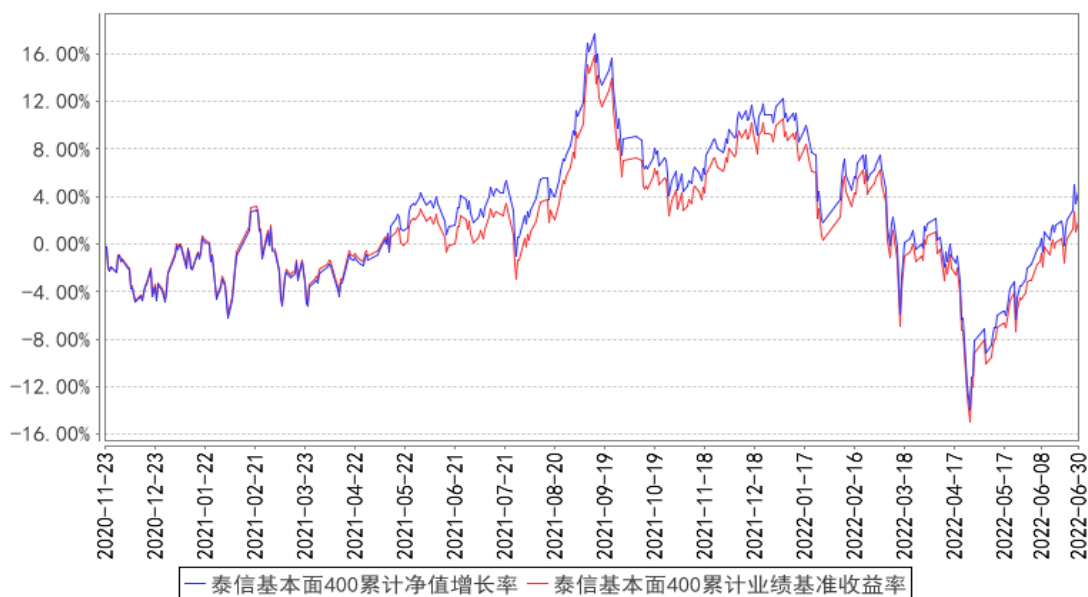
注：本基金业绩比较基准为： $95\% \times$ 中证锐联基本面 400 指数收益率 $+ 5\% \times$ 商业银行人民币活期存款利率（税后）

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

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

3.2.2 自基金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

泰信基本面400累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金于 2020 年 11 月 24 日变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 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、泰信竞争优选混合、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		
董山青	权益投资部总监助理、泰信蓝筹精选混合型证券投资基金	2021 年 8 月 5 日	-	18 年	董山青先生，香港大学工商管理专业硕士。曾任中国银行上海分行业务经理。2004 年 8 月加入泰信基金管理有限公司，历任交易员、研究员、研究总监助理、基金经理助理，现任权益投资部总监助理。2012 年 2 月至今任泰信行业精选灵活配置混合型

	<p>金基金经理、泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金（原泰信保本混合型证券投资基金）基金经理、泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金经理（原泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转型）、泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理、泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>				<p>证券投资基金基金经理（原泰信保本混合型证券投资基金转型），2016 年 2 月至今任泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 8 月至今任泰信蓝筹精选混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金经理（原泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转型），2021 年 8 月至今任泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内各指数涨跌幅分别为：上证综指-6.09%，中小综指-10.13%，创业板指-15.41%。

报告期内，本基金作为被动操作的指数基金，严格执行基金合同规定的投资策略，按照规定的投资策略和方法进行投资操作，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，报告期内跟踪误差控制在 1.2%。报告期跟踪误差主要是由于基金申购赎回和标的指数成分股定期调整等因素所造成。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2378 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.46%，业绩比较基准收益率为-7.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年疫情后国内经济恢复迅速，人民币币值保持强势，吸引了大量国际资本进入中国。A 股基本已经摆脱了疫情影响。虽然近期国内疫情有所反复，对部分行业造成一定影响，但是国家采取了多种方式提振经济，总体影响不大。而受损行业如航空、机场、旅游、酒店、影院等板块受到疫情反复的影响，处于震荡阶段。目前疫情已经得到控制，重点城市 15 分钟核酸检测服务圈也已基本建立。期待国产特效药的出现，最终可以结束疫情，疫情受损行业将会出现恢复性增长。

随着近期美国的货币和财政政策逐步转为紧缩，我们需要关注美国通胀预期上行带来的全球紧缩预期。自俄乌冲突以来，全球政局变幻，中美之间的问题也将长期存在。中国资本市场对外开放的步伐不断加快，A 股国际化背景下海外资金不断流入，同时资本市场各项改革加速推进等均利好 A 股。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，保证基金估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本公司建立估值委员会，负责本公司基金估值业务的决策和评价、与基金估值业务相关的信息披露规定等工作。

本公司管理的基金日常估值由公司清算会计部负责。清算会计部完成估值后，将估值结果以合同约定的形式发送基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后，由管理人按约定对外公布；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。本公司在采用估值政策和程序时，应当充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过建立估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、本基金收益分配应遵循下列原则：

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额的持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再

投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额的持有人只能选择现金分红的方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的规定；

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

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

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期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合规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	908,318.68	1,432,534.35
结算备付金		-	-
存出保证金		19.17	110.83
交易性金融资产	6.4.7.2	12,591,448.37	23,831,343.98
其中：股票投资		12,591,448.37	23,831,343.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		-	19,408.84
应收股利		-	-
应收申购款		3,674.78	1,498.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	140.11
资产总计		13,503,461.00	25,285,036.31
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
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		-	-
应付赎回款		486.03	63.73
应付管理人报酬		18,252.68	21,187.57
应付托管费		4,015.62	4,661.25
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	43,377.21	86,226.62
负债合计		66,131.54	112,139.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	7,131,537.73	12,496,626.99
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	6,305,791.73	12,676,270.15
净资产合计		13,437,329.46	25,172,897.14
负债和净资产总计		13,503,461.00	25,285,036.31

注：1. 报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2378 元，基金份额总额 10,855,786.47 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：泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）

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	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,562,890.89	2,194,630.88
1. 利息收入		2,588.73	4,156.17
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,588.73	4,156.17
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		954,481.52	4,354,190.04
其中：股票投资收益	6.4.7.10	649,716.83	4,089,590.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收	6.4.7.12	-	-

益			
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	304,764.69	264,599.75
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	-2,520,402.99	-2,164,255.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	441.85	540.29
减：二、营业总支出		172,764.11	366,469.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	112,636.11	196,306.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,780.00	43,187.39
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	35,348.00	126,975.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,735,655.00	1,828,161.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,735,655.00	1,828,161.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,735,655.00	1,828,161.51

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：泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）

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
----	----

	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)	12,496,626.99	-	12,676,270.15	25,172,897.14
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)	12,496,626.99	-	12,676,270.15	25,172,897.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,365,089.26	-	-6,370,478.42	-11,735,567.68
(一)、综合收益总额	-	-	-1,735,655.00	-1,735,655.00
(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)	-5,365,089.26	-	-4,634,823.42	-9,999,912.68
其中:1.基金申购款	249,667.22	-	175,336.07	425,003.29
2.基金赎回款	-5,614,756.48	-	-4,810,159.49	-10,424,915.97
(三)、	-	-	-	-

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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	7,131,537.73	-	6,305,791.73	13,437,329.46
项目	上年度可比期间 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、上期期末净资产(基金净值)	25,548,318.82	-	19,410,812.29	44,959,131.11
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)	25,548,318.82	-	19,410,812.29	44,959,131.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,898,114.03	-	-8,399,496.04	-21,297,610.07

(一)、 综合收益总额	-	-	1,828,161.51	1,828,161.51
(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)	-12,898,114.03	-	-10,227,657.55	-23,125,771.58
其中:1. 基金申购款	241,775.33	-	188,363.01	430,138.34
2. 基金赎回款	-13,139,889.36	-	-10,416,020.56	-23,555,909.92
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	12,650,204.79	-	11,011,316.25	23,661,521.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 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 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、应收利息, 金额分别为人民币 1,432,534.35 元、人民币 0 元、人民币 110.83 元、人民币 140.11 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、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、其他资产-应收利息、的金额分别为人民币 1,432,674.46 元、人民币 0 元、人民币 110.83 元、人民币 0。

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 23,831,343.98 元, 归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 0 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 238,313,43.98 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	908,318.68
等于：本金	908,078.09
加：应计利息	240.59
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	908,318.68

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 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	12,132,824.14	-	12,591,448.37	458,624.23
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,132,824.14	-	12,591,448.37	458,624.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 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 2022 年 6 月 30 日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.84
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	17,235.37
其中：交易所市场	17,235.37
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	14,876.39
应付指数使用费	11,263.61
合计	43,377.21

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	19,023,176.92	12,496,626.99
本期申购	380,055.45	249,667.22
本期赎回（以“-”号填列）	-8,547,445.90	-5,614,756.48
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	10,855,786.47	7,131,537.73

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	10,923,484.12	1,752,786.03	12,676,270.15
本期利润	784,747.99	-2,520,402.99	-1,735,655.00
本期基金份额交易产生的变动数	-4,867,525.20	232,701.78	-4,634,823.42
其中：基金申购款	217,586.84	-42,250.77	175,336.07
基金赎回款	-5,085,112.04	274,952.55	-4,810,159.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,840,706.91	-534,915.18	6,305,791.73

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
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	-
其他	0.19
合计	2,588.73

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	649,716.83
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	649,716.83

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	14,872,795.50
减：卖出股票成本总额	14,189,314.32
减：交易费用	33,764.35
买卖股票差价收入	649,716.83

6.4.7.11 债券投资收益

本报告期本基金无债券投资收益。

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	304,764.69
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	304,764.69

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,520,402.99
股票投资	-2,520,402.99
债券投资	-
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	-2,520,402.99

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	441.85
合计	441.85

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

6.4.7.18 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
	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	208.00

账户维护费	9,000.00
指数使用费	11,263.61
合计	35,348.00

注：根据泰信基金管理有限公司 2016 年 8 月 5 日公布的《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金调整指数许可使用费并修改基金合同的公告》，经与本基金的托管人中国工商银行股份有限公司以及中证指数有限公司协商一致后，并报中国证监会备案，泰信基金管理有限公司决定调整本基金的指数许可使用费和每季度指数许可使用费的收取下限，并相应对《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》内容进行修订。修订后的相关合同条款规定：如果本基金前一年度日均资产规模净值超过或等于 40 亿元，则本年度的指数许可使用基点费按照万分九的年费率计提；如果不足 40 亿元，则本年度的指数许可使用费按照万分之十的年费率计提。基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用费人民币 5 万元的收取下限，则该下限超出当季累计指数使用费的部分（即：每季指数许可使用费收取下限减当季累计指数许可使用费）由基金管理人自行承担，不作为基金费用从基金财产中列支。标的指数许可使用费每日计算，逐日累计。计算方法如下：

日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 适用的指数许可使用费率 / 当年天数。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本报告期无需要说明资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期本基金控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司（“泰信基金管理有限公司”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	112,636.11	196,306.47
其中：支付销售机构的客户维护费	8,128.48	8,817.73

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 1.00%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×1.00%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,780.00	43,187.39

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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×0.22%÷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未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**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
报告期初持有的基金份额	15,710,482.63	15,710,482.63
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	8,270,000.00	-
报告期末持有的基金份额	7,440,482.63	15,710,482.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	68.54%	81.58%

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		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
中国工商银行	908,318.68	2,588.54	1,746,180.03	4,144.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设审计、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工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选

择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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 13,502,715.21 元，超过经确认的当日净赎回金额。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	908,318.68	-	-	-	908,318.68
存出保证金	19.17	-	-	-	19.17
交易性金融资产	-	-	-	12,591,448.37	12,591,448.37
应收申购款	-	-	-	3,674.78	3,674.78
资产总计	908,337.85	-	-	12,595,123.15	13,503,461.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	486.03	486.03
应付管理人报酬	-	-	-	18,252.68	18,252.68
应付托管费	-	-	-	4,015.62	4,015.62
其他负债	-	-	-	43,377.21	43,377.21

负债总计	-	-	-	66,131.54	66,131.54
利率敏感度缺口	908,337.85	-	-	-12,528,991.61	13,437,329.46
上年度末 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	1,432,534.35	-	-	-	1,432,534.35
存出保证金	110.83	-	-	-	110.83
交易性金融资产	-	-	-	-23,831,343.98	23,831,343.98
应收证券清算款	-	-	-	19,408.84	19,408.84
应收利息	-	-	-	140.11	140.11
应收申购款	-	-	-	1,498.20	1,498.20
资产总计	1,432,645.18	-	-	-23,852,391.13	25,285,036.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	63.73	63.73
应付管理人报酬	-	-	-	21,187.57	21,187.57
应付托管费	-	-	-	4,661.25	4,661.25
应付交易费用	-	-	-	20.19	20.19
其他负债	-	-	-	86,206.43	86,206.43
负债总计	-	-	-	112,139.17	112,139.17
利率敏感度缺口	1,432,645.18	-	-	-23,740,251.96	25,172,897.14

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

于2022年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2021年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021年12月31日：同)。

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 2022年6月30日		上年度末 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	12,591,448.37	93.70	23,831,343.98	94.67

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	12,591,448.37	93.70	23,831,343.98	94.67

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%	657,018.22	1,237,975.11
	2. 业绩比较基准下降 5%	-657,018.22	-1,237,975.11

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	12,591,448.37	23,831,343.98
第二层次	-	-
第三层次	-	-

合计	12,591,448.37	23,831,343.98
----	---------------	---------------

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	12,591,448.37	93.25
	其中：股票	12,591,448.37	93.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	908,318.68	6.73
8	其他各项资产	3,693.95	0.03
9	合计	13,503,461.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	86,457.18	0.64
B	采矿业	582,581.30	4.34
C	制造业	6,055,380.17	45.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	400,268.75	2.98
E	建筑业	321,581.77	2.39
F	批发和零售业	751,258.06	5.59
G	交通运输、仓储和邮政业	342,116.09	2.55
H	住宿和餐饮业	26,229.30	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	285,911.95	2.13
J	金融业	1,098,984.42	8.18
K	房地产业	310,443.10	2.31
L	租赁和商务服务业	146,664.94	1.09
M	科学研究和技术服务业	65,721.68	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	49,142.01	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,311.88	0.02
Q	卫生和社会工作	31,383.77	0.23
R	文化、体育和娱乐业	110,191.32	0.82
S	综合	-	-
	合计	10,667,627.69	79.39

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	105,098.00	0.78
C	制造业	912,739.34	6.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	137,433.96	1.02
E	建筑业	152,376.16	1.13
F	批发和零售业	244,536.21	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	106,654.19	0.79
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	109,254.39	0.81
K	房地产业	130,060.20	0.97
L	租赁和商务服务业	12,224.15	0.09
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	13,444.08	0.10
S	综合	-	-
	合计	1,923,820.68	14.32

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601377	兴业证券	13,119	92,488.95	0.69
2	600522	XD 中天科	3,494	80,711.40	0.60
3	600418	江淮汽车	4,358	74,783.28	0.56
4	000039	中集集团	5,295	73,335.75	0.55
5	000661	长春高新	303	70,726.26	0.53
6	300059	东方财富	2,697	68,503.80	0.51
7	002271	东方雨虹	1,294	66,602.18	0.50
8	603259	药明康德	632	65,721.68	0.49
9	002129	TCL 中环	1,104	65,014.56	0.48
10	600873	梅花生物	5,733	64,668.24	0.48
11	600096	云天化	2,040	64,219.20	0.48
12	000878	云南铜业	5,565	63,385.35	0.47
13	002001	新 和 成	2,682	61,176.42	0.46
14	601128	常熟银行	7,996	61,089.44	0.45
15	000034	神州数码	3,979	60,560.38	0.45
16	600487	亨通光电	4,129	60,035.66	0.45
17	002241	歌尔股份	1,743	58,564.80	0.44
18	600332	白云山	1,831	57,841.29	0.43
19	600348	华阳股份	3,729	57,650.34	0.43

20	600703	三安光电	2,345	57,640.10	0.43
21	300226	上海钢联	2,533	57,372.45	0.43
22	600584	长电科技	2,099	56,673.00	0.42
23	000938	紫光股份	2,851	55,309.40	0.41
24	600143	金发科技	5,807	55,282.64	0.41
25	600426	华鲁恒升	1,884	55,012.80	0.41
26	601555	东吴证券	7,933	54,975.69	0.41
27	600176	中国巨石	3,128	54,458.48	0.41
28	600745	闻泰科技	638	54,300.18	0.40
29	600699	均胜电子	3,415	53,649.65	0.40
30	002958	青农商行	16,141	53,588.12	0.40
31	603799	华友钴业	557	53,260.34	0.40
32	600637	东方明珠	7,431	53,131.65	0.40
33	002416	爱施德	5,663	52,665.90	0.39
34	000783	长江证券	8,800	52,184.00	0.39
35	000786	北新建材	1,494	51,722.28	0.38
36	600489	中金黄金	6,978	51,567.42	0.38
37	600801	华新水泥	2,627	51,252.77	0.38
38	600390	五矿资本	10,475	51,222.75	0.38
39	600500	中化国际	7,700	51,205.00	0.38
40	002384	东山精密	2,196	50,354.28	0.37
41	000963	华东医药	1,099	49,630.84	0.37
42	000977	浪潮信息	1,874	49,623.52	0.37
43	600516	方大炭素	6,504	49,430.40	0.37
44	002236	大华股份	2,968	48,734.56	0.36
45	002311	海大集团	803	48,188.03	0.36
46	002299	圣农发展	2,499	47,930.82	0.36
47	600256	广汇能源	4,446	46,860.84	0.35
48	600502	安徽建工	6,502	46,814.40	0.35
49	002221	东华能源	5,002	46,568.62	0.35
50	000983	山西焦煤	3,462	46,356.18	0.34
51	000830	鲁西化工	2,679	46,319.91	0.34
52	300122	智飞生物	416	46,180.16	0.34
53	601636	旗滨集团	3,584	45,696.00	0.34
54	002385	大北农	5,807	45,352.67	0.34
55	601615	明阳智能	1,314	44,413.20	0.33
56	600271	航天信息	4,001	43,770.94	0.33
57	601168	西部矿业	3,648	43,155.84	0.32
58	600893	航发动力	948	43,143.48	0.32
59	300058	蓝色光标	6,602	43,111.06	0.32
60	002078	太阳纸业	3,494	43,011.14	0.32
61	002233	塔牌集团	4,828	42,727.80	0.32

62	002183	怡亚通	5,914	42,639.94	0.32
63	000050	深天马A	4,270	42,571.90	0.32
64	000027	深圳能源	6,631	42,504.71	0.32
65	000060	中金岭南	9,525	42,481.50	0.32
66	601108	财通证券	5,395	42,458.65	0.32
67	603858	步长制药	2,154	42,455.34	0.32
68	600567	山鹰国际	15,293	42,361.61	0.32
69	000728	国元证券	6,783	42,190.26	0.31
70	600546	山煤国际	2,161	42,053.06	0.31
71	600039	四川路桥	3,991	42,025.23	0.31
72	002340	格林美	4,611	41,960.10	0.31
73	600739	辽宁成大	2,875	41,917.50	0.31
74	000581	威孚高科	2,177	41,907.25	0.31
75	000488	晨鸣纸业	7,360	41,510.40	0.31
76	600507	方大特钢	5,933	41,471.67	0.31
77	600008	首创环保	14,210	41,209.00	0.31
78	000951	中国重汽	3,110	40,398.90	0.30
79	000829	天音控股	3,387	40,339.17	0.30
80	600141	兴发集团	912	40,118.88	0.30
81	600208	新湖中宝	14,528	40,097.28	0.30
82	600060	海信视像	3,205	40,062.50	0.30
83	000960	锡业股份	2,360	39,577.20	0.29
84	600711	盛屯矿业	5,023	38,978.48	0.29
85	002050	三花智控	1,407	38,664.36	0.29
86	002244	滨江集团	4,452	38,509.80	0.29
87	600409	三友化工	4,699	38,484.81	0.29
88	600061	国投资本	6,020	38,287.20	0.28
89	600497	驰宏锌锗	7,365	38,224.35	0.28
90	002203	海亮股份	3,288	37,976.40	0.28
91	002456	欧菲光	5,651	37,918.21	0.28
92	002422	科伦药业	2,025	37,867.50	0.28
93	600266	城建发展	9,207	37,564.56	0.28
94	000059	华锦股份	6,343	37,550.56	0.28
95	603156	养元饮品	1,630	37,033.60	0.28
96	002091	江苏国泰	3,430	36,872.50	0.27
97	000090	天健集团	5,330	36,723.70	0.27
98	000690	宝新能源	8,341	36,533.58	0.27
99	000413	东旭光电	18,600	36,456.00	0.27
100	002120	韵达股份	2,124	36,235.44	0.27
101	600482	中国动力	2,306	36,227.26	0.27
102	002061	浙江交科	5,196	36,164.16	0.27
103	300677	英科医疗	1,420	36,011.20	0.27

104	600511	国药股份	1,342	35,938.76	0.27
105	600827	百联股份	2,717	35,891.57	0.27
106	002004	华邦健康	6,432	35,890.56	0.27
107	600021	上海电力	3,500	35,875.00	0.27
108	600528	中铁工业	4,456	35,870.80	0.27
109	002048	宁波华翔	2,237	35,836.74	0.27
110	600859	王府井	1,377	35,774.46	0.27
111	000623	吉林敖东	2,414	35,630.64	0.27
112	002966	苏州银行	5,779	35,251.90	0.26
113	002008	大族激光	1,060	35,117.80	0.26
114	600056	中国医药	2,365	35,049.30	0.26
115	600535	天士力	3,326	34,956.26	0.26
116	603589	口子窖	595	34,872.95	0.26
117	600600	青岛啤酒	335	34,813.20	0.26
118	002555	三七互娱	1,630	34,604.90	0.26
119	600166	福田汽车	12,066	34,146.78	0.25
120	002408	齐翔腾达	4,188	33,964.68	0.25
121	601000	唐山港	13,163	33,960.54	0.25
122	300274	阳光电源	344	33,798.00	0.25
123	000016	深康佳 A	5,575	33,728.75	0.25
124	002602	世纪华通	6,988	33,682.16	0.25
125	600233	圆通速递	1,645	33,541.55	0.25
126	300207	欣旺达	1,058	33,432.80	0.25
127	300146	汤臣倍健	1,540	33,341.00	0.25
128	300124	汇川技术	504	33,198.48	0.25
129	600183	生益科技	1,952	33,164.48	0.25
130	002128	电投能源	2,312	33,107.84	0.25
131	600970	中材国际	3,415	33,091.35	0.25
132	603816	顾家家居	584	33,071.92	0.25
133	000768	中航西飞	1,089	32,985.81	0.25
134	600875	东方电气	2,000	32,900.00	0.24
135	000723	美锦能源	2,685	32,757.00	0.24
136	002230	科大讯飞	790	32,563.80	0.24
137	601666	平煤股份	2,394	32,534.46	0.24
138	000933	神火股份	2,486	32,516.88	0.24
139	603225	新凤鸣	2,798	32,288.92	0.24
140	600380	健康元	2,612	32,258.20	0.24
141	000921	海信家电	2,271	32,202.78	0.24
142	601058	赛轮轮胎	2,853	32,153.31	0.24
143	600863	内蒙华电	8,758	31,966.70	0.24
144	300070	碧水源	6,101	31,786.21	0.24
145	600908	无锡银行	5,624	31,663.12	0.24

146	601333	广深铁路	14,512	31,636.16	0.24
147	002589	瑞康医药	8,119	31,582.91	0.24
148	300015	爱尔眼科	701	31,383.77	0.23
149	600307	酒钢宏兴	16,166	31,362.04	0.23
150	600150	中国船舶	1,648	31,279.04	0.23
151	000513	丽珠集团	846	30,633.66	0.23
152	000883	湖北能源	5,946	30,384.06	0.23
153	000591	太阳能	3,637	30,368.95	0.23
154	600498	烽火通信	2,083	30,161.84	0.22
155	000717	韶钢松山	8,604	30,114.00	0.22
156	600064	南京高科	2,730	30,030.00	0.22
157	300003	乐普医疗	1,617	30,027.69	0.22
158	600085	同仁堂	566	29,930.08	0.22
159	601878	浙商证券	2,610	29,701.80	0.22
160	002938	鹏鼎控股	983	29,696.43	0.22
161	600273	嘉化能源	2,733	29,680.38	0.22
162	002572	索菲亚	1,079	29,672.50	0.22
163	601212	白银有色	10,744	29,653.44	0.22
164	601717	郑煤机	2,057	29,641.37	0.22
165	601901	方正证券	4,415	29,624.65	0.22
166	600973	宝胜股份	5,112	29,598.48	0.22
167	601360	三六零	3,471	29,572.92	0.22
168	000789	万年青	2,725	29,539.00	0.22
169	002075	沙钢股份	6,140	29,533.40	0.22
170	600729	重庆百货	1,364	29,421.48	0.22
171	600004	白云机场	1,971	29,387.61	0.22
172	600667	太极实业	3,934	29,032.92	0.22
173	002085	万丰奥威	5,398	28,987.26	0.22
174	600109	国金证券	3,193	28,737.00	0.21
175	600742	一汽富维	3,096	28,730.88	0.21
176	000423	东阿阿胶	777	28,710.15	0.21
177	600126	杭钢股份	5,585	28,595.20	0.21
178	600549	厦门钨业	1,319	28,516.78	0.21
179	601001	晋控煤业	1,600	28,400.00	0.21
180	600100	同方股份	6,376	28,373.20	0.21
181	002508	老板电器	783	28,211.49	0.21
182	002081	金螳螂	5,528	28,082.24	0.21
183	600623	华谊集团	3,349	27,796.70	0.21
184	002745	木林森	2,845	27,795.65	0.21
185	002080	中材科技	1,010	27,775.00	0.21
186	601198	东兴证券	3,109	27,670.10	0.21
187	601860	紫金银行	9,641	27,669.67	0.21

188	600373	中文传媒	2,761	27,582.39	0.21
189	002673	西部证券	4,191	27,409.14	0.20
190	600160	巨化股份	2,080	27,352.00	0.20
191	601098	中南传媒	2,891	27,291.04	0.20
192	600663	陆家嘴	2,626	27,205.36	0.20
193	601611	中国核建	3,237	27,158.43	0.20
194	600111	北方稀土	770	27,073.20	0.20
195	600466	蓝光发展	16,211	27,072.37	0.20
196	601872	招商轮船	4,680	26,956.80	0.20
197	601966	玲珑轮胎	1,061	26,917.57	0.20
198	002007	华兰生物	1,180	26,904.00	0.20
199	000028	国药一致	902	26,870.58	0.20
200	000078	海王生物	7,297	26,561.08	0.20
201	600079	人福医药	1,654	26,464.00	0.20
202	600918	中泰证券	3,430	26,239.50	0.20
203	000750	国海证券	7,227	26,234.01	0.20
204	600754	锦江酒店	417	26,229.30	0.20
205	600720	祁连山	2,112	26,188.80	0.19
206	600959	江苏有线	8,025	26,161.50	0.19
207	002926	华西证券	3,329	26,099.36	0.19
208	600884	杉杉股份	875	26,005.00	0.19
209	601866	中远海发	8,617	25,851.00	0.19
210	002459	晶澳科技	324	25,563.60	0.19
211	600308	华泰股份	4,465	25,495.15	0.19
212	601718	际华集团	8,216	25,469.60	0.19
213	000528	柳 工	3,862	25,141.62	0.19
214	600597	光明乳业	1,982	25,032.66	0.19
215	600583	海油工程	5,991	24,862.65	0.19
216	601231	环旭电子	1,731	24,857.16	0.18
217	300408	三环集团	824	24,802.40	0.18
218	600483	福能股份	1,744	24,538.08	0.18
219	000887	中鼎股份	1,340	24,441.60	0.18
220	600369	西南证券	6,096	24,201.12	0.18
221	600298	安琪酵母	496	24,180.00	0.18
222	600909	华安证券	5,301	24,119.55	0.18
223	600657	信达地产	3,500	24,115.00	0.18
224	000031	大悦城	6,018	24,072.00	0.18
225	600123	兰花科创	1,463	24,066.35	0.18
226	000807	云铝股份	2,435	24,057.80	0.18
227	600809	山西汾酒	74	24,035.20	0.18
228	002648	卫星化学	929	24,014.65	0.18
229	600491	龙元建设	3,482	23,747.24	0.18

230	601567	三星医疗	1,777	23,598.56	0.18
231	600335	国机汽车	2,357	23,593.57	0.18
232	600565	迪马股份	10,147	23,541.04	0.18
233	002157	正邦科技	3,878	23,500.68	0.17
234	002468	申通快递	1,971	23,494.32	0.17
235	600277	亿利洁能	4,698	23,490.00	0.17
236	600578	京能电力	7,489	23,440.57	0.17
237	000686	东北证券	3,345	23,381.55	0.17
238	002010	传化智联	3,633	23,360.19	0.17
239	000301	东方盛虹	1,370	23,166.70	0.17
240	000501	武商集团	2,083	23,121.30	0.17
241	002440	闰土股份	2,866	23,099.96	0.17
242	000999	华润三九	512	23,040.00	0.17
243	002948	青岛银行	6,346	22,972.52	0.17
244	601995	中金公司	515	22,912.35	0.17
245	600569	安阳钢铁	8,725	22,859.50	0.17
246	600415	小商品城	4,069	22,664.33	0.17
247	000937	冀中能源	3,036	22,648.56	0.17
248	601686	友发集团	2,962	22,629.68	0.17
249	000975	银泰黄金	2,318	22,577.32	0.17
250	600787	中储股份	3,935	22,390.15	0.17
251	600582	天地科技	4,671	22,327.38	0.17
252	002294	信立泰	793	22,283.30	0.17
253	601609	金田股份	2,964	22,259.64	0.17
254	600612	XD 老凤祥	531	22,185.18	0.17
255	000672	上峰水泥	1,404	22,155.12	0.16
256	600058	五矿发展	2,157	22,087.68	0.16
257	600997	开滦股份	2,895	22,059.90	0.16
258	002013	中航机电	1,776	21,933.60	0.16
259	000718	苏宁环球	5,946	21,881.28	0.16
260	000987	越秀金控	3,092	21,736.76	0.16
261	000598	兴蓉环境	4,222	21,574.42	0.16
262	000685	中山公用	2,801	21,511.68	0.16
263	002841	视源股份	285	21,466.20	0.16
264	600760	中航沈飞	355	21,459.75	0.16
265	002500	山西证券	3,721	21,358.54	0.16
266	603260	合盛硅业	181	21,350.76	0.16
267	600566	济川药业	775	21,049.00	0.16
268	000156	华数传媒	2,617	20,857.49	0.16
269	600436	片仔癀	58	20,690.34	0.15
270	000950	重药控股	4,086	20,430.00	0.15
271	002237	恒邦股份	2,081	20,393.80	0.15

272	000550	江铃汽车	1,257	20,212.56	0.15
273	002563	森马服饰	3,388	20,056.96	0.15
274	600901	江苏租赁	3,807	19,529.91	0.15
275	600682	南京新百	1,933	19,368.66	0.14
276	600971	恒源煤电	2,435	19,236.50	0.14
277	601021	春秋航空	328	19,138.80	0.14
278	002372	伟星新材	796	19,135.84	0.14
279	600835	上海机电	1,379	18,933.67	0.14
280	600588	用友网络	867	18,822.57	0.14
281	600026	中远海能	1,815	18,748.95	0.14
282	601886	江河集团	2,218	18,742.10	0.14
283	600737	中粮糖业	2,486	18,694.72	0.14
284	603806	福斯特	284	18,607.68	0.14
285	000543	皖能电力	4,624	18,449.76	0.14
286	601179	中国西电	3,895	18,228.60	0.14
287	002042	华孚时尚	4,800	18,144.00	0.14
288	000990	诚志股份	1,646	18,023.70	0.13
289	002032	苏泊尔	318	17,916.12	0.13
290	603369	今世缘	350	17,850.00	0.13
291	688036	传音控股	200	17,846.00	0.13
292	603766	隆鑫通用	3,822	17,619.42	0.13
293	603198	迎驾贡酒	270	17,587.80	0.13
294	603195	公牛集团	115	17,584.65	0.13
295	002242	九阳股份	951	17,460.36	0.13
296	601928	凤凰传媒	2,436	17,417.40	0.13
297	000967	盈峰环境	3,430	17,355.80	0.13
298	002064	华峰化学	2,056	17,352.64	0.13
299	002152	广电运通	1,854	17,186.58	0.13
300	000559	万向钱潮	2,874	17,071.56	0.13
301	600977	中国电影	1,482	17,043.00	0.13
302	600295	鄂尔多斯	940	16,967.00	0.13
303	600038	中直股份	375	16,950.00	0.13
304	002831	裕同科技	569	16,813.95	0.13
305	000537	广宇发展	1,259	16,354.41	0.12
306	000600	建投能源	3,863	16,301.86	0.12
307	603866	桃李面包	980	16,219.00	0.12
308	603885	吉祥航空	898	16,155.02	0.12
309	002302	西部建设	2,044	15,861.44	0.12
310	603833	欧派家居	105	15,821.40	0.12
311	601187	厦门银行	2,631	15,680.76	0.12
312	600167	联美控股	2,060	15,429.40	0.11
313	002532	天山铝业	2,347	15,325.91	0.11

314	600598	北大荒	1,018	15,025.68	0.11
315	002419	天虹股份	2,098	14,958.74	0.11
316	601828	美凯龙	2,457	14,889.42	0.11
317	002939	长城证券	1,377	13,990.32	0.10
318	000596	古井贡酒	56	13,980.96	0.10
319	601958	金钼股份	1,566	13,843.44	0.10
320	600968	海油发展	5,214	13,452.12	0.10
321	600231	凌钢股份	4,968	13,115.52	0.10
322	300741	华宝股份	467	12,991.94	0.10
323	601808	中海油服	908	12,666.60	0.09
324	601298	青岛港	2,301	12,586.47	0.09
325	600395	盘江股份	1,413	12,392.01	0.09
326	601568	北元集团	1,940	12,299.60	0.09
327	603056	德邦股份	896	12,033.28	0.09
328	300033	同花顺	111	10,672.65	0.08
329	601139	深圳燃气	1,467	10,180.98	0.08
330	600299	安迪苏	863	8,267.54	0.06
331	000958	电投产融	1,132	5,139.28	0.04
332	002607	中公教育	572	3,311.88	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002202	金风科技	6,500	96,200.00	0.72
2	600352	浙江龙盛	7,941	80,839.38	0.60
3	600839	四川长虹	27,096	78,036.48	0.58
4	600820	隧道股份	12,280	75,153.60	0.56
5	600157	永泰能源	47,200	75,048.00	0.56
6	601788	XD 光大证	4,005	63,118.80	0.47
7	600196	复星医药	1,429	63,004.61	0.47
8	000778	新兴铸管	12,259	59,088.38	0.44
9	000906	浙商中拓	6,052	54,952.16	0.41
10	600009	上海机场	932	52,844.40	0.39
11	688981	中芯国际	1,030	46,525.10	0.35
12	002460	赣锋锂业	300	44,610.00	0.33
13	600547	山东黄金	2,400	44,544.00	0.33
14	600674	川投能源	3,482	41,505.44	0.31
15	000701	厦门信达	6,039	37,743.75	0.28
16	600398	海澜之家	7,788	36,993.00	0.28
17	600596	新安股份	1,600	34,640.00	0.26
18	601677	明泰铝业	1,427	33,962.60	0.25
19	601258	庞大集团	24,015	33,380.85	0.25

20	601005	重庆钢铁	17,200	32,852.00	0.24
21	000626	远大控股	2,566	32,228.96	0.24
22	000683	远兴能源	2,905	30,531.55	0.23
23	688599	天合光能	459	29,949.75	0.22
24	300014	亿纬锂能	300	29,250.00	0.22
25	600823	世茂股份	9,600	28,608.00	0.21
26	600339	中油工程	9,800	28,322.00	0.21
27	601588	北辰实业	11,200	26,208.00	0.20
28	002185	华天科技	2,680	25,138.40	0.19
29	002600	领益智造	4,911	24,653.22	0.18
30	600717	天津港	6,111	24,505.11	0.18
31	600248	陕西建工	4,336	23,544.48	0.18
32	600708	光明地产	9,400	23,218.00	0.17
33	002180	纳思达	458	23,183.96	0.17
34	600713	南京医药	4,507	21,949.09	0.16
35	002603	以岭药业	900	21,870.00	0.16
36	601963	重庆银行	2,682	21,295.08	0.16
37	000498	山东路桥	2,175	21,010.50	0.16
38	603501	韦尔股份	117	20,244.51	0.15
39	600981	汇鸿集团	6,846	19,853.40	0.15
40	600649	XD 城投控	4,609	19,726.52	0.15
41	601918	新集能源	3,800	19,380.00	0.14
42	600916	中国黄金	1,656	19,375.20	0.14
43	002179	中航光电	300	18,996.00	0.14
44	601100	恒立液压	300	18,516.00	0.14
45	600675	中华企业	6,000	18,360.00	0.14
46	600939	重庆建工	3,880	16,800.40	0.13
47	600180	瑞茂通	2,169	16,744.68	0.12
48	002916	深南电路	172	16,118.12	0.12
49	002761	浙江建投	514	15,867.18	0.12
50	000761	本钢板材	4,112	14,803.20	0.11
51	600707	彩虹股份	3,133	14,662.44	0.11
52	601880	辽港股份	8,500	14,450.00	0.11
53	600848	上海临港	1,028	13,939.68	0.10
54	688819	天能股份	400	13,832.00	0.10
55	300413	芒果超媒	403	13,444.08	0.10
56	600871	石化油服	6,800	12,852.00	0.10
57	000785	居然之家	2,747	12,224.15	0.09
58	600548	深高速	1,142	10,894.68	0.08
59	601158	重庆水务	1,900	10,165.00	0.08
60	601236	红塔证券	917	8,372.21	0.06
61	603071	物产环能	458	8,308.12	0.06

62	600098	广州发展	1,312	8,213.12	0.06
63	601665	齐鲁银行	1,315	6,417.20	0.05
64	001227	兰州银行	1,100	5,412.00	0.04
65	600927	永安期货	230	4,639.10	0.03
66	300979	华利集团	58	4,238.64	0.03
67	601156	东航物流	200	3,960.00	0.03
68	001289	龙源电力	115	2,502.40	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002202	金风科技	144,301.00	0.57
2	600157	永泰能源	143,244.00	0.57
3	600352	浙江龙盛	143,031.00	0.57
4	600839	四川长虹	133,950.00	0.53
5	600820	隧道股份	131,150.00	0.52
6	601788	光大证券	112,346.00	0.45
7	000778	新兴铸管	108,790.00	0.43
8	600196	复星医药	106,950.00	0.42
9	000906	浙商中拓	94,644.00	0.38
10	688981	中芯国际	82,494.00	0.33
11	600547	山东黄金	79,506.00	0.32
12	600009	上海机场	75,408.00	0.30
13	600674	川投能源	72,393.00	0.29
14	600398	海澜之家	69,877.00	0.28
15	000701	厦门信达	66,889.00	0.27
16	600596	新安股份	64,764.00	0.26
17	601258	庞大集团	58,940.00	0.23
18	601677	明泰铝业	57,357.00	0.23
19	601005	重庆钢铁	57,190.00	0.23
20	000626	远大控股	55,664.00	0.22

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	600522	中天科技	193,085.76	0.77
2	600256	广汇能源	169,418.38	0.67
3	600348	华阳股份	158,113.79	0.63
4	600325	华发股份	156,148.14	0.62
5	600873	梅花生物	116,567.30	0.46
6	000983	山西焦煤	115,179.76	0.46
7	601233	桐昆股份	108,645.78	0.43

8	601699	潞安环能	107,418.13	0.43
9	600502	安徽建工	105,386.11	0.42
10	601666	平煤股份	103,589.54	0.41
11	000401	冀东水泥	102,287.85	0.41
12	600546	山煤国际	99,927.93	0.40
13	300118	东方日升	98,776.00	0.39
14	002183	怡亚通	93,124.00	0.37
15	600418	江淮汽车	88,933.00	0.35
16	600710	苏美达	84,370.55	0.34
17	600233	圆通速递	84,185.46	0.33
18	600056	中国医药	74,748.00	0.30
19	000537	广宇发展	72,355.63	0.29
20	002244	滨江集团	70,993.00	0.28

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,469,821.70
卖出股票收入（成交）总额	14,872,795.50

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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	19.17
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,674.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,693.95

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
684	15,871.03	7,634,069.86	70.32	3,221,716.61	29.68

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 9 月 7 日）基 金份额总额	39,447,859.47
本报告期期初基金份额总额	19,023,176.92
本报告期基金总申购份额	380,055.45
减：本报告期基金总赎回份额	8,547,445.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,855,786.47

§ 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(%)	
中泰证券	1	12,030,054.42	59.14	11,204.44	64.82	-
德邦证券	1	8,246,304.78	40.54	6,030.93	34.89	-
西藏东财	1	32,024.00	0.16	23.42	0.14	-
华福证券	1	25,266.00	0.12	18.48	0.11	-
民生证券	1	8,968.00	0.04	8.35	0.05	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
野村东方 证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

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

2、本报告期内本基金新增交易单元：天风证券深圳 001905、野村东方国际证券上海 54798；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 (%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
野村东方 证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 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	《证券时报》、规定网站	2022年1月7日
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	《证券时报》、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	《证券时报》、规定网站	2022年1月17日
4	2021年第4季度报告	《证券时报》、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	《证券时报》、规定网站	2022 年 1 月 26 日
6	泰信基本面 400 指数 (LOF) 基金更新招募说明书 (2022 年 1 号)、产品资料概要更新	《证券时报》、规定网站	2022 年 3 月 11 日
7	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	《证券时报》、规定网站	2022 年 3 月 24 日
8	2021 年年度报告	《证券时报》、规定网站	2022 年 3 月 29 日
9	2022 年第 1 季度报告	《证券时报》、规定网站	2022 年 4 月 21 日
10	关于基金行业高级管理人员变更的公告	《证券时报》、规定网站	2022 年 4 月 28 日
11	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	《证券时报》、规定网站	2022 年 6 月 10 日
12	关于旗下部分基金新增江海证券有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》、规定网站	2022 年 6 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101-20220630	15,710,482.63	0.00	8,270,000.00	7,440,482.63	68.54

产品特有风险

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金设立，变更的文件
- 2、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 4、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、报告期内本基金在规定媒介对外披露的各项公告

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

泰信基金管理有限公司

2022 年 8 月 26 日