

# 泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>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
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<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.....	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>

8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	50
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	50
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	50
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
8.11 投资组合报告附注.....	51
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	52
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	53
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	54
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
11.4 基金投资策略的改变.....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
11.8 其他重大事件.....	55
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	57
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
13.1 备查文件目录.....	57
13.2 存放地点.....	57
13.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金	
基金简称	泰信鑫瑞债券发起式	
基金主代码	013614	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 17 日	
基金管理人	泰信基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,201,245.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C
下属分级基金的交易代码	013614	013615
报告期末下属分级基金的份 额总额	10,044,248.52 份	156,997.29 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据宏观经济运行状况、政策形势、利率走势、信用状况等的综合判断，并结合各大类资产的估值水平和风险收益特征，在基金合同规定的范围内决定各类资产的配置比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露 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	95511-3
传真	021-20899008	0755-82080387
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	200120	518001
法定代表人	李高峰	谢永林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
----------------	---------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36、37 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年 3 月 17 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C
本期已实现收益	-316,676.94	-5,725.60
本期利润	-612,168.57	-14,748.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0608	-0.0758
本期加权平均净值利润率	-6.19%	-7.70%
本期基金份额净值增长率	-6.10%	-6.17%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	
期末可供分配利润	-612,233.50	-9,687.42
期末可供分配基金份额利润	-0.0610	-0.0617
期末基金资产净值	9,432,015.02	147,309.87
期末基金份额净值	0.9390	0.9383
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-6.10%	-6.17%

注：1、本基金基金合同生效日为 2022 年 3 月 17 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

泰信鑫瑞债券发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.47%	0.28%	0.18%	0.12%	-2.65%	0.16%
过去六个月	-6.81%	0.34%	-0.08%	0.11%	-6.73%	0.23%
自基金合同生效起至今	-6.10%	0.29%	1.89%	0.12%	-7.99%	0.17%

泰信鑫瑞债券发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.49%	0.28%	0.18%	0.12%	-2.67%	0.16%
过去六个月	-6.85%	0.34%	-0.08%	0.11%	-6.77%	0.23%
自基金合同生效起至今	-6.17%	0.29%	1.89%	0.12%	-8.06%	0.17%

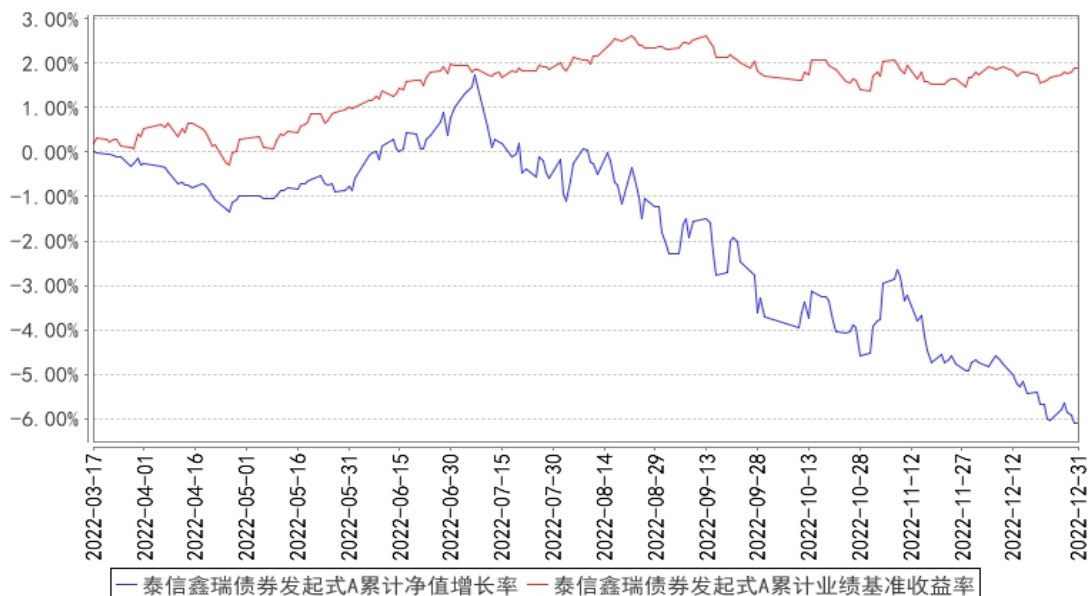
注：本基金业绩比较基准：中证综合债指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%

中证综合债券指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数，该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，具有较强的市场代表性。

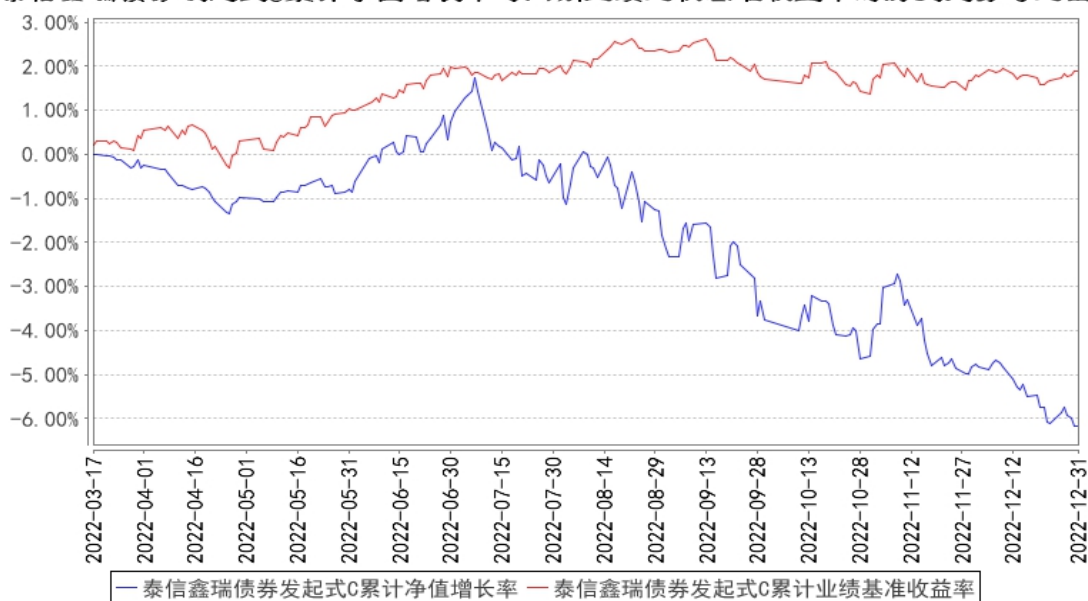
沪深 300 指数的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

### 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

泰信鑫瑞债券发起式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



泰信鑫瑞债券发起式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



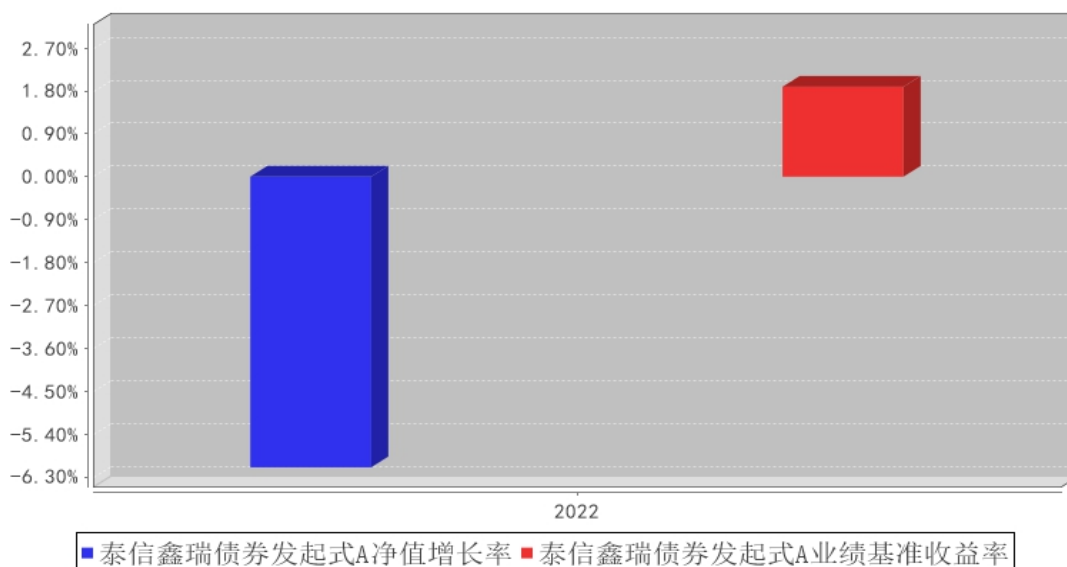
注：1、本基金基金合同于 2022 年 3 月 17 日生效。

2、基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，股票的投资比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终应当保持现金或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。

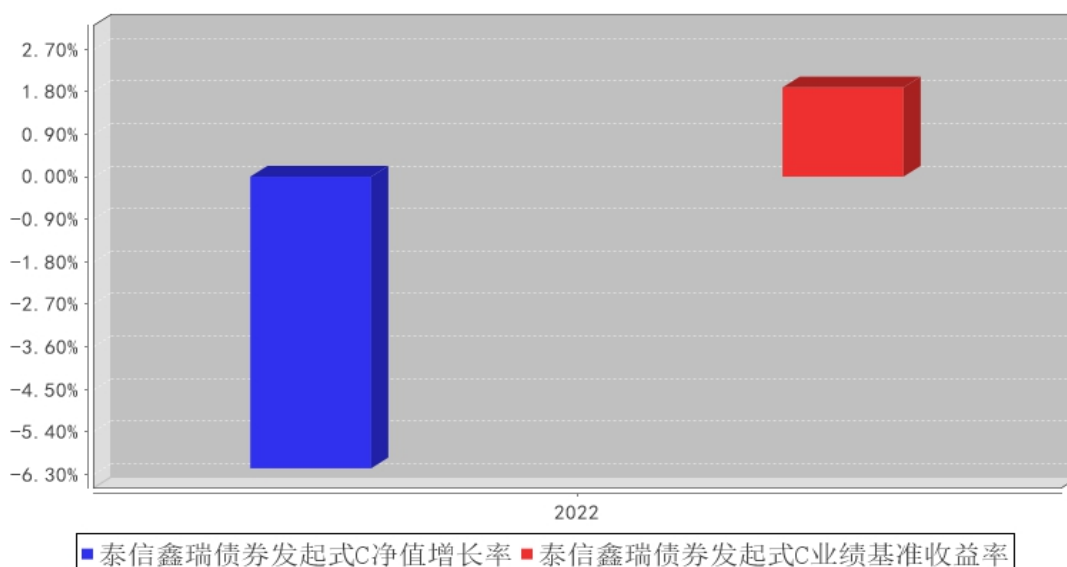


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰信鑫瑞债券发起式A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



泰信鑫瑞债券发起式C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2022 年 3 月 17 日正式生效，2022 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2022年3月17日正式生效。本报告期本基金未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 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。

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 12 月末，公司有正式员工 102 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 12 月末，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、泰信优势领航混合、泰信汇鑫三个月定开债券、泰信添鑫中短债债券共 32 只开放式基金及 44 个资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张安格	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、泰信基金汇鑫三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2022 年 3 月 17 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，2022 年 10 月至今任泰信基金汇鑫三个月定期开放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》、《泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。

2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。

3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。

4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

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

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的同时反向交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易部集中执行，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，根据投资交易监控与价差分析情况，未发现基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年无论是在经济、政策、国际局势，还是各类资产价格表现上，都是比较超预期的一年。回顾 2021 年末大家对 2022 年的展望，会发现世界的变化总是多端莫测，资本市场的表现也是充满了各种惊喜和意外，并非集体智慧就能轻易预测。尽管 2022 年经济增速未达年初制定的目标，但是这一整年我们在各个方面都做过很多积极而有意义的尝试，为今后的发展积累了很多宝贵的经验。中国经济健康发展的良好基本面并没有发生根本性的改变，这是我们对未来充满信心的基石。

2022 年 A 股市场的各类宽基指数基本都表现不佳，主要原因在于：（1）经济增长动力不足，使得多数 A 股上市企业的盈利增速下滑甚至转负；（2）美联储超预期的加息幅度和节奏对全球各类权益资产的估值产生了一定的压制。如果说指数层面的下跌可以从事后验证的角度得到比较合理的解释，那行情结构则更多地体现出情绪化的影响。单从基本面的角度来说，2022 年的 A 股是

可以找到相对比较明确的主线的，但事实是全年 A 股板块轮动非常快，单一热点的持续时间较短，且都不足以带动整个 A 股有所起色。而且，我们发现市场过度强调对预期尤其是反转预期的定价，且不论预期实现的概率有多大，而对确定性的基本面事实则考虑较少，这就造成不同板块间估值的失衡性有所加剧。总体来看，2022 年 A 股缩量博弈的氛围较为浓厚，价值投资的理念体现不足。

2022 年债券市场牛市持续的时间比年初预期的更长，但年末调整的剧烈程度也大超预期。经济增长乏力和资金面持续宽松使得债券市场收益率在前十个月明显下行，而且强化了市场的多头情绪和投资行为，多数投资者并没有为可能到来的风险做提前准备。而债券的流动性相对较差，是需要具备左侧投资能力的资产品种。11 月，几大政策的突然出台改变了债市继续的牛市的基本逻辑，引发了债市的调整。而银行理财净值化以后，债市的一致行动现象又变得空前明显，更是加剧了市场调整的幅度和延长了负反馈的持续时间。应该说，这一轮的债市调整，无论是对理财和债基的持有人，还是对专业的债券投资人，都上了一堂意义深刻的投资者教育课。

2022 年，本基金在权益持仓上集中度较高，导致净值波动较大，未能给基金持有人带来良好的持有体验。意识到问题后，本基金对权益仓位做了适当均衡，但仍围绕景气成长领域布局。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信鑫瑞债券发起式 A 基金份额净值为 0.9390 元,本报告期基金份额净值增长率为-6.10%;截止本报告期末泰信鑫瑞债券发起式 C 基金份额净值为 0.9383 元,本报告期基金份额净值增长率为-6.17%;同期业绩比较基准收益率为 1.89%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，我们认为权益市场至少存在结构性的机会，主要原因在于：第一，疫情对经济的束缚已基本消除，此前我们已经积累了一些宝贵的防疫经验，即便后续有二轮疫情冲击，我们也能从容应对，因此预计疫情不会成为扰动经济复苏进程的主要因素。经济向好会使 A 股整体的盈利增速向好，基本面优化。第二，资金面尽管难以像 2022 年那样宽松，但是在稳增长的宏观目标下仍会继续保持合理充裕，宽松的流动性有利于权益市场的估值修复。第三，国内刺激经济的政策空间还比较充足，当前我们也感受到了政府对于稳增长、促经济的信心和决心，预计未来各类支持政策还会不断出台。第四，美联储预计于 2023 年底或 2024 年初进入降息周期，这对全球的权益市场估值会是利好，尤其利好成长类标的的估值。

在权益投资方面，有些 2022 跌得比较多的板块恰好是基本面相对较好的领域，这些标的目前的胜率和赔率都不错，在 2023 年跑出相对收益应该是大概率事件，可以重点挖掘在这些领域具有  $\alpha$  属性的公司。在债券投资上，防利率风险和信用风险将是重中之重。大部分时候我们可能都需要保持组合较低的久期，根据资金面情况适度使用杠杆。在基本面并不支持债券牛市的情况下，

2023 年债券市场最大的机会可能是跌出来的，超调会提供好的买点。此外，2023 年还需加强对投资组合的流动性管理，减少规模大幅变动对账户净值的超额影响。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

##### 1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

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

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

(1) 加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议、政策法规规定对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。

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

##### 3、加强内部的监察稽核

针对基金投资运作通过日常监察与专项稽核相结合，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，通过查漏补缺、及时整改强化了风险控制流程，提高了投资管理及运营相关人员的风险意识水平，从而较好地预防风险，维护基金持有人利益。

##### 4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。

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

在本报告期内，本基金的投资运作等各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的

合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

##### 一、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。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。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

#### 4.9 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

本报告期内无需要说明的相关情形。

## § 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、



基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(23)第 P00402 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金全体持有人：
审计意见	我们审计了泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	泰信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不

	<p>对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告</p>

	日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金不能持续经营。	
	(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。	
	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	胡小骏	谭麟林
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	158,500.07
结算备付金		19,495.59
存出保证金		2,397.74
交易性金融资产	7.4.7.2	9,229,086.37
其中：股票投资		802,064.20
基金投资		-
债券投资		8,427,022.17
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
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		306,375.62
应收股利		-
应收申购款		600.00
递延所得税资产		-

其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		9,716,455.39
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		4,927.73
应付托管费		821.27
应付销售服务费		13.34
应付投资顾问费		-
应交税费		169.58
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	131,198.58
负债合计		137,130.50
<b>净资产:</b>		
实收基金	7.4.7.7	10,201,245.81
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-621,920.92
净资产合计		9,579,324.89
负债和净资产总计		9,716,455.39

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 10,201,245.81 份。其中：泰信鑫瑞债券发起式 A 份额净值人民币 0.9390 元，基金份额总额 10,044,248.52 份；泰信鑫瑞债券发起式 C 份额净值人民币 0.9383 元，基金份额总额 156,997.29 份。本基金合同生效日为 2022 年 3 月 17 日。

2、本财务报表的实际编制期间为 2022 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间，无上年度末可比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2022 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日

<b>一、营业总收入</b>		-431,742.82
1. 利息收入		69,936.70
其中：存款利息收入	7.4.7.9	13,765.30
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		56,171.40
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-197,166.65
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-272,362.81
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	74,011.46
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	1,184.70
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）	7.4.7.16	-304,514.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1.79
<b>减：二、营业总支出</b>		195,174.38
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	47,871.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	7,978.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	151.81
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	7.4.7.18	-
7. 税金及附加		172.56
8. 其他费用	7.4.7.19	139,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-626,917.20
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-626,917.20
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-626,917.20

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31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）	-	-	-	-
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）	10,451,659.01	-	-	10,451,659.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-250,413.20	-	-621,920.92	-872,334.12
（一）、综合收益总额	-	-	-626,917.20	-626,917.20
（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）	-250,413.20	-	4,996.28	-245,416.92
其中：1. 基金申购款	303,416.93	-	684.06	304,100.99
2. 基金赎回款	-553,830.13	-	4,312.22	-549,517.91
（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）	10,201,245.81	-	-621,920.92	9,579,324.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

高宇

基金管理人负责人

叶振宇

主管会计工作负责人

叶振宇

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金(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[2021]第 2780 号《关于准予泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金注册的批复》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《泰信鑫瑞债券型发起式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基金,存续期限为不定期。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 10,451,659.01 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(22)第 00139 号验资报告。《泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2022 年 3 月 17 日正式生效。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市交易的股票(包括主板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、债券回购、货币市场工具等,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的相关规定。本基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%,股票的投资比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终应当保持现金或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。本基金业绩比较基准为中证综合债指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2022 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付,且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

##### 2) 金融负债的分类



根据本基金的业务模式和现金流量特征要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预

期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在

估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实

现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

##### 2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

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

### 3) 公允价值变动收益

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

### 4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收

益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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 2022 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的财务报表时已采用该准则。

本基金自 2022 年 7 月 1 日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号), 并按相关衔接规定进行了处理。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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，受让方不再缴纳印花税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元



项目	本期末	
	2022 年 12 月 31 日	
活期存款	158,500.07	
等于：本金	158,451.99	
加：应计利息	48.08	
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	158,500.07	

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,019,560.83	-	802,064.20	-217,496.63	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,397,708.13	116,332.07	8,427,022.17	-87,018.03
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,397,708.13	116,332.07	8,427,022.17	-87,018.03
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	9,417,268.96	116,332.07	9,229,086.37	-304,514.66	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售资产。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	1,198.58
其中：交易所市场	1,198.58
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	130,000.00
合计	131,198.58

## 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

## 泰信鑫瑞债券发起式 A

项目	本期 2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,138,447.87	10,138,447.87
本期申购	40,824.60	40,824.60
本期赎回（以“-”号填列）	-135,023.95	-135,023.95
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	10,044,248.52	10,044,248.52

## 泰信鑫瑞债券发起式 C

项目	本期 2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	313,211.14	313,211.14
本期申购	262,592.33	262,592.33
本期赎回（以“-”号填列）	-418,806.18	-418,806.18
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	156,997.29	156,997.29

注：1、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。

2、本基金自 2022 年 2 月 14 日至 2022 年 3 月 14 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 10,451,080.04 元，折合为 10,451,080.04 份基金份额（其中 A 类基金份额 10,138,010.04

份，C类基金份额 313,070.00 份)。根据《泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 578.97 元在本基金成立后，折合为 578.97 基金份额(其中 A 类基金份额 437.83 份，C 类基金份额 141.14 份)，划入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

泰信鑫瑞债券发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-316,676.94	-295,491.63	-612,168.57
本期基金份额交易产生的变动数	158.29	-223.22	-64.93
其中：基金申购款	-112.75	121.81	9.06
基金赎回款	271.04	-345.03	-73.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-316,518.65	-295,714.85	-612,233.50

泰信鑫瑞债券发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-5,725.60	-9,023.03	-14,748.63
本期基金份额交易产生的变动数	657.96	4,403.25	5,061.21
其中：基金申购款	-1,960.54	2,635.54	675.00
基金赎回款	2,618.50	1,767.71	4,386.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,067.64	-4,619.78	-9,687.42

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	13,005.52
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	738.42
其他	21.36
合计	13,765.30

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-272,362.81
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	-272,362.81

#### 7.4.7.10.2 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3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,300,105.37
减：卖出股票成本总额	1,568,014.64
减：交易费用	4,453.54
买卖股票差价收入	-272,362.81

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	115,299.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-41,287.69
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	74,011.46

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,676,135.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,591,961.04
减：应计利息总额	125,376.88
减：交易费用	85.35
买卖债券差价收入	-41,287.69

**7.4.7.12 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。

**7.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,184.70
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,184.70

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-304,514.66
股票投资	-217,496.63
债券投资	-87,018.03
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	-304,514.66

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	1.79
合计	1.79

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

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

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	139,000.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
山东省鲁信投资控股集团有限公司（“鲁信集团”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司	基金管理人的股东
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**7.4.10.1.2 债券交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**7.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	47,871.47
其中：支付销售机构的客户维护费	505.80

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×0.60%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,978.54

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年3月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C	合计
平安银行	-	86.10	86.10
泰信基金管理有限公司	-	0.86	0.86

合计	-	86.96	86.96
----	---	-------	-------

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 0.10% 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×0.10%÷当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	本期 2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C
基金合同生效日（2022 年 3 月 17 日）持有的基金份额	10,001,261.14	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,261.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	98.04%	-

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

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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元



关联方名称	本期 2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行	158,500.07	13,005.52

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配的情况。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易作为抵押的债券。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是债券型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括债券投资、资产支持证券投资、银行存款等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人平安银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6 列示了于本报告期末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日
AAA	3,420,721.64
AAA 以下	181,386.22
未评级	-
合计	3,602,107.86

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。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息。

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评

估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为人民币 9,578,181.91 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	158,500.07	-	-	-	158,500.07
结算备付金	19,495.59	-	-	-	19,495.59
存出保证金	2,397.74	-	-	-	2,397.74
交易性金融资产	6,816,370.13	1,128,493.16	482,158.88	802,064.20	9,229,086.37
应收申购款	-	-	-	600.00	600.00
应收清算款	-	-	-	306,375.62	306,375.62
资产总计	6,996,763.53	1,128,493.16	482,158.88	1,109,039.82	9,716,455.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,927.73	4,927.73
应付托管费	-	-	-	821.27	821.27
应付销售服务费	-	-	-	13.34	13.34
应交税费	-	-	-	169.58	169.58

其他负债	-	-	-	131,198.58	131,198.58
负债总计	-	-	-	137,130.50	137,130.50
利率敏感度缺口	6,996,763.53	1,128,493.16	482,158.88	971,909.32	9,579,324.89

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；	
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)
		本期末(2022年12月31日)
	1. 市场利率上升 25 个基点	-20,101.60
	2. 市场利率下降 25 个基点	20,296.40

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	802,064.20	8.37
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	802,064.20	8.37

##### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

其他价格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除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	2,004,420.42
第二层次	7,224,665.95
第三层次	-
合计	9,229,086.37

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期末无第三层次公允价值余额及变动情况。

###### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	802,064.20	8.25
	其中：股票	802,064.20	8.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,427,022.17	86.73
	其中：债券	8,427,022.17	86.73
	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	177,995.66	1.83
8	其他各项资产	309,373.36	3.18
9	合计	9,716,455.39	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	802,064.20	8.37
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	802,064.20	8.37

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002738	中矿资源	2,100	139,986.00	1.46
2	002460	赣锋锂业	1,920	133,459.20	1.39
3	300568	星源材质	6,000	127,560.00	1.33
4	002466	天齐锂业	1,500	118,485.00	1.24
5	002240	盛新锂能	2,000	74,980.00	0.78
6	000932	华菱钢铁	10,000	47,000.00	0.49
7	002709	天赐材料	1,000	43,860.00	0.46
8	603659	璞泰来	800	41,512.00	0.43
9	300750	宁德时代	100	39,342.00	0.41
10	688388	嘉元科技	800	35,880.00	0.37

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	218,307.00	2.28
2	002460	赣锋锂业	187,438.00	1.96
3	000546	金圆股份	176,910.00	1.85
4	688388	嘉元科技	163,626.33	1.71
5	002756	永兴材料	161,280.00	1.68
6	002497	雅化集团	155,486.00	1.62
7	002738	中矿资源	148,549.00	1.55
8	300568	星源材质	147,598.00	1.54
9	002240	盛新锂能	135,635.00	1.42
10	002192	融捷股份	127,427.00	1.33
11	601677	明泰铝业	115,302.00	1.20



12	688099	晶晨股份	107,247.75	1.12
13	688677	海泰新光	65,895.00	0.69
14	002873	新天药业	60,000.00	0.63
15	603658	安图生物	59,040.00	0.62
16	688271	联影医疗	58,500.00	0.61
17	600110	诺德股份	50,960.00	0.53
18	002709	天赐材料	47,800.00	0.50
19	688077	大地熊	47,486.00	0.50
20	688185	康希诺	46,600.00	0.49

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000546	金圆股份	154,505.00	1.61
2	002497	雅化集团	138,796.00	1.45
3	002756	永兴材料	105,250.00	1.10
4	688388	嘉元科技	105,000.00	1.10
5	002192	融捷股份	99,200.00	1.04
6	688099	晶晨股份	83,503.00	0.87
7	601677	明泰铝业	67,054.00	0.70
8	002873	新天药业	62,800.00	0.66
9	688677	海泰新光	61,580.37	0.64
10	688271	联影医疗	51,945.00	0.54
11	603658	安图生物	51,600.00	0.54
12	688185	康希诺	46,000.00	0.48
13	600110	诺德股份	45,680.00	0.48
14	002007	华兰生物	42,300.00	0.44
15	688351	微电生理	42,000.00	0.44
16	688077	大地熊	38,105.00	0.40
17	688212	澳华内镜	37,872.00	0.40
18	002466	天齐锂业	35,405.00	0.37
19	603799	华友钴业	31,510.00	0.33

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,587,575.47
卖出股票收入（成交）总额	1,300,105.37

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	4,824,914.31	50.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	305,267.16	3.19
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,094,484.48	21.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,202,356.22	12.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,427,022.17	87.97

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019638	20 国债 09	19,000	1,924,571.42	20.09
2	019679	22 国债 14	17,000	1,711,655.48	17.87
3	019629	20 国债 03	11,000	1,120,827.07	11.70
4	163287	20 控租 01	5,000	512,268.36	5.35
5	163211	20 海国 01	5,000	509,643.70	5.32

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

### 8.10.2 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。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 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

赣锋锂业于 2022 年 12 月 6 日收到中国证监会江西监管局出具的《行政处罚事先告知书》（赣处罚字〔2022〕4 号），公司涉嫌违反《证券法》，构成内幕交易行为。本基金管理人认为对公司主营业务、收入、净利润不构成重大影响，同时不构成退市风险。公司作为全球锂盐行业中的龙头，企业经营有望继续保持良好。

### 8.11.2 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库之外的股票。

### 8.11.3 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	2,397.74
2	应收清算款	306,375.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	600.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	309,373.36

### 8.11.4 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	113042	上银转债	367,492.71	3.84
2	113056	重银转债	248,664.30	2.60
3	110053	苏银转债	185,575.56	1.94
4	110085	通 22 转债	119,186.33	1.24
5	113053	隆 22 转债	114,308.25	1.19
6	110059	浦发转债	104,929.18	1.10
7	127038	国微转债	62,199.89	0.65

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
泰信鑫瑞债券发起式 A	29	346,353.40	10,001,261.14	99.57	42,987.38	0.43
泰信鑫瑞债券发起式 C	180	872.21	-	-	156,997.29	100
合计	209	48,809.79	10,001,261.14	98.04	199,984.67	1.96

### 9.2 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	泰信鑫瑞债券发起式 A	9.97	0.0001
	泰信鑫瑞债券发起式 C	140.07	0.0892
	合计	150.04	0.0015

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,261.14	98.04	10,001,261.14	98.04	自基金合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,261.14	98.04	10,001,261.14	98.04	自基金合同生效之日起不少于 3 年

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C
基金合同生效日 (2022 年 3 月 17 日) 基金份额总额	10,138,447.87	313,211.14
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	40,824.60	262,592.33
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	135,023.95	418,806.18
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	10,044,248.52	156,997.29

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2022 年 4 月 26 日起，公司总经理高宇先生代任公司董事长职务，万众先生不再担任公司董事长职务。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，公司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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所审计费为人民币 3.00 万元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚情况。

#### 11.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国盛证券	2	3,887,680.84	100.00	2,843.09	100.00	-
天风证券	2	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、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：国盛证券上海 54627，国盛证券深圳 015019，天风证券上海 54200，天风证券深圳 014763；退租交易单元：无。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国盛证券	24,532,109.78	100.00	103,900,000.00	100.00	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金发行募集文件	《中国证券报》、规定网站	2022 年 1 月 28 日
2	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金新增销售机构公告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 2 月 14 日
3	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金合同生效公告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 3 月 18 日
4	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 3 月 17 日
5	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金开放申购赎回业务公告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 4 月 13 日
6	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金在	《中国证券报》、规定网	2022 年 4 月 25 日

	部分销售机构开通定投、转换及参加费率优惠活动的公告	站	
7	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
8	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 7 月 20 日
9	关于旗下部分开放式基金新增中国人寿保险股份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 7 月 29 日
10	关于旗下部分开放式基金新增南京证券股份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 8 月 22 日
11	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金 2022 年中期报告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 8 月 26 日
12	关于旗下部分开放式基金新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构并开通转换及定期定额投资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 9 月 2 日
13	关于旗下部分开放式基金新增北京中植基金销售有限公司为销售机构并开通转换及定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 9 月 2 日
14	关于旗下部分开放式基金新增九州证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 9 月 9 日
15	关于旗下部分开放式基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 9 月 21 日
16	关于旗下部分开放式基金新增上海云湾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 10 月 17 日
17	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 10 月 25 日
18	关于旗下部分开放式基金新增德邦证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	《中国证券报》、规定网站	2022 年 11 月 25 日
19	关于旗下部分开放式基金新增海通证券股份有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资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 12 月 12 日
20	关于旗下部分基金新增兴业银行股份有	《中国证券报》、规定网	2022 年 12 月 14 日



	限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	站	
--	---------------------------------------	---	--

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220317 - 20221231	10,001,261.14	0.00	0.00	10,001,261.14	98.04
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。							

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信鑫瑞债券型发起式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、基金托管人业务资格批件和营业执照

### 13.2 存放地点

本报告分别置于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

### 13.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)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

2023 年 3 月 30 日