

# 泰信优质生活混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
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	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41

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 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	41
7.12 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4 基金投资策略的改变 .....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰信优质生活混合型证券投资基金
基金简称	泰信优质生活混合
基金主代码	290004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 12 月 15 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	282,433,557.36 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济可持续发展过程中那些最能够 满足人们优质生活需求的上市公司的长期稳定增长，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的大类资产配置、以核心-卫星策略为基础的优质生活行业配置和“自下而上”的证券精选相结合的投资策略。
业绩比较基准	75%×富时中国 A600 指数+25%×富时中国国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。适合于能够承担一定股市风险，追求资本长期增值的个人和机构投资者。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	泰信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘小舫
	联系电话	021-20899003
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com
客户服务电话	400-888-5988	95566
传真	021-20899008	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36-37 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	李高峰	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	12,798,081.91
本期利润	21,407,361.51
加权平均基金份额本期利润	0.0746
本期加权平均净值利润率	10.28%
本期基金份额净值增长率	10.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-69,526,135.38
期末可供分配基金份额利润	-0.2462
期末基金资产净值	212,907,421.98
期末基金份额净值	0.7538
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	62.58%

注：1、本基金基金合同于 2006 年 12 月 15 日正式生效。本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型基金。

2、所述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用，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	-0.80%	1.68%	0.51%	0.63%	-1.31%	1.05%
过去三个月	3.05%	2.72%	-3.87%	0.58%	6.92%	2.14%
过去六个月	10.89%	2.08%	-0.74%	0.58%	11.63%	1.50%

过去一年	-18.30%	1.88%	-10.14%	0.70%	-8.16%	1.18%
过去三年	-1.16%	1.73%	-1.48%	0.88%	0.32%	0.85%
自基金合同生效起至今	62.58%	1.75%	92.00%	1.24%	-29.42%	0.51%

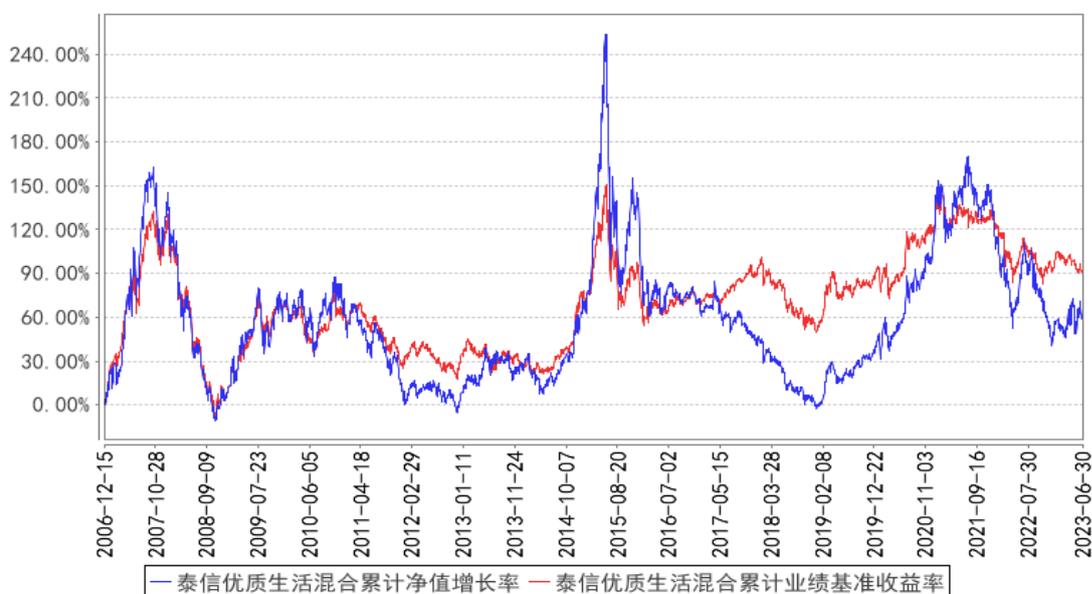
注：本基金业绩比较基准为：75%×富时中国 A600 指数+25%×富时中国国债指数

1、富时中国 A600 指数是富时中国指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大的 600 只股票并以流通股本加权的股票指数。

2、富时中国国债指数涵盖了在上海及深圳交易所交易的到期日至少在一年以上的纯定息债券，是目前中国证券市场中与本基金投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数和债券指数。

### 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

泰信优质生活混合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、泰信优质生活股票基金合同于 2006 年 12 月 15 日正式生效。本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型基金。

2、本基金投资组合相关约定为：股票资产 60%-95%，债券资产 0%-35%，基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

## § 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 2023 年 6 月末，公司有正式员工 110 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 2023 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、泰信优势领航、泰信添鑫中短债、泰信汇鑫三个月定开共 32 只开放式基金及 55 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		
吴秉韬	研究部总监、泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泰信优质生活混合型证券投资基金基金经理、泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金基金经理、泰信优势领航混合型证券投资基金基金经理	2021 年 10 月 12 日	-	12 年	吴秉韬先生，上海交通大学环境工程专业硕士。2011 年 4 月加入泰信基金管理有限公司，历任助理研究员、研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理兼研究员，现任研究部总监兼基金经理。2019 年 7 月至今任泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月至今任泰信优质生活混合型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月至今任泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 9 月至今任泰信优势领航混合型证券投资基金基金经理。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从《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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信优质生活混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《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相关的各环节，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，基金经理严格遵守公平、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本基金与其他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

2023 年一季度，3 月官方制造业 PMI 录得 51.9%，较上月回落 0.7 个百分点，整体仍处景气区间，但较 2 月有所回调，有相当原因在于春节错位影响。需求端方面，3 月新订单指数为 53.6%，相较上月下降 0.5 个百分点；生产指数为 54.6%，相较上月下降 2.1 个百分点，生产景气度仍要略高于需求景气度，两者均位于荣枯线之上。3 月 PMI 新出口订单录得 50.4，较前值下滑了 2 个百分点，今年我国的出口环境变得相对复杂。价格方面，3 月主要原材料购进价格指数为 50.9%，较前值 54.4%下降 3.5 个百分点。出厂价格指数为 48.6%，较前值 51.2%下降 2.6 个百分点，出厂价格指数重回收缩区间。产成品库存和原材料库存分别为 49.5%和 48.3%，受生产加速、需求修复影响，库存指数小幅回落。3 月建筑业与服务业商务活动指数双双续升至 65.6%、56.9%，景气扩张的持续性的确好于制造业。向前看，服务业的景气持续性或好于建筑业，服务业新订单指数高位续升至 58.5%，录得 2012 年有数据以来的新高；而建筑业新订单指数大幅回落至 50.2%，需求有边际走弱的可能。总体来看，3 月官方 PMI 数据反映出我国经济基本面持续修复的趋势仍在持续，后续经济进一步的复苏情况取决于外需走弱、内需修复以及行业层面房地产行业修复进程的综合影响，仍有待进一步验证。流动性方面，3 月央行公开市场逆回购大幅净回笼，MLF 超额续

作净投放，同时超预期降准投放中长期流动性，由此来看，央行操作延续缩短放长的思路。尽管央行投放中长期流动性，但资金面整体明显收敛，且上行幅度超季节性，尤其 R007 和 DR007 显示流动性分层加剧，这或显示融资需求延续强势，银行在季末信贷投放增加。我们认为在经济恢复尚处于脆弱的阶段，货币政策宽松的逻辑并未发生显著变化。本基金一季度适当降低了新能源板块配置，并适当增加了 TMT 板块配置。

2023 年二季度，6 月官方制造业 PMI 录得 49%，较上月回升 0.2 个百分点，6 月 PMI 延续 4，5 月继续低迷，仍处于收缩区间，需求不足可能是制约当前制造业生产回暖的重要因素。需求端方面，6 月生产指数回升 0.7 个百分点至 50.3%，重回扩张区间，但仍为近 5 年最低水平。生产小幅扩张暂未带动企业采购增加，反映企业生产经营预期仍相对谨慎。新订单指数回升 0.3 个百分点至 48.6%，为近 5 年的最低水平，制造业需求仍偏弱。新出口订单指数回落 0.8 个百分点至 46.4%，外需也仍偏弱。价格方面，6 月购进价格与出厂价格指数分别回升 4.2、2.3 个百分点至 45.0%、43.9%，仍显著低于 50% 的临界水平。6 月非制造业商务活动指数回落 1.3 个百分点至 53.2%，为近 10 年 6 月份最低水平，非制造业扩张速度有所放缓。非制造业商务活动指数回落主要原因是房地产走弱导致房屋建筑业增长放缓。总体来看，制造业景气度基本持平，小幅改善且持续性不强，需求仍然偏弱，企业仍在加速去库存；出口动能继续回落；保就业压力在增加，当前经济仍在承压，政策发力的必要性增强。展望后续，经济环比动能或将进入震荡筑底时期。流动性方面，二季度货币政策例会在“精准有力实施稳健的货币政策，搞好跨周期调节”的同时，明确要“加大宏观政策调控力度”“切实支持扩大内需，改善消费环境，促进经济良性循环”、“加大逆周期调节力度，综合运用政策工具，切实服务实体经济”。我们认为在稳健的大基调下，央行将发挥结构性货币政策工具的作用。本基金二季度适当降低传媒行业，增加通信行业配置。

#### 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 0.7538 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.89%，业绩比较基准收益率为-0.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对当前宏观环境的判断：6 月官方制造业 PMI 录得 49%，较上月回升 0.2 个百分点，6 月 PMI 延续 4，5 月继续低迷，仍处于收缩区间，需求不足可能是制约当前制造业生产回暖的重要因素。需求端方面，6 月生产指数回升 0.7 个百分点至 50.3%，重回扩张区间，但仍为近 5 年最低水平。生产小幅扩张暂未带动企业采购增加，反映企业生产经营预期仍相对谨慎。新订单指数回升 0.3 个百分点至 48.6%，为近 5 年的最低水平，制造业需求仍偏弱。新出口订单指数回落 0.8 个百分点至 46.4%，外需也仍偏弱。价格方面，6 月购进价格与出厂价格指数分别回升 4.2、2.3 个

百分点至 45.0%、43.9%，仍显著低于 50% 的临界水平。供需的边际改善使得价格下降速度有所放缓。6 月非制造业商务活动指数回落 1.3 个百分点至 53.2%，为近 10 年 6 月份最低水平，比近 10 年的中位数水平低 1.1 个百分点，非制造业扩张速度有所放缓。非制造业商务活动指数回落主要原因是房地产走弱导致房屋建筑业增长放缓。

流动性方面，二季度货币政策例会在“精准有力实施稳健的货币政策，搞好跨周期调节”的同时，明确要“加大宏观政策调控力度”“切实支持扩大内需，改善消费环境，促进经济良性循环”、“加大逆周期调节力度，综合运用政策工具，切实服务实体经济”。我们认为在稳健的大基调下，央行将发挥结构性货币政策工具的作用。

总结来看，从 6 月经济数据看，制造业景气度基本持平，小幅改善且持续性不强，需求仍然偏弱，企业仍在加速去库存；出口动能继续回落；保就业压力在增加，当前经济仍在承压，政策发力的必要性增强。展望后续，经济环比动能或将进入震荡筑底时期。此种经济基本面，我们认为下半年整体货币环境，大概率维持相对宽松环境，企业盈利或将进入震荡筑底阶段，增量资金有限，市场将呈现存量博弈，结构性特征明显。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定：

1、基金收益分配采用现金方式，投资者可选择将获取的现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

- 5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少 1 次；
- 7、全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

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

无

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泰信优质生活混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	19,981,191.77	17,142,934.74
结算备付金		1,842,383.29	3,367,702.21
存出保证金		154,267.01	205,466.51
交易性金融资产	6.4.7.2	186,595,763.18	176,882,769.78
其中：股票投资		186,595,763.18	176,882,769.78
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		7,042,579.12	1,426,179.89
应收股利		-	-
应收申购款		7,162.84	6,459.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		215,623,347.21	199,031,513.09
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,036,765.85	-
应付赎回款		6,763.30	16,447.82
应付管理人报酬		265,599.28	268,125.95
应付托管费		44,266.54	44,687.68
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	1,362,530.26	1,851,684.81

负债合计		2,715,925.23	2,180,946.26
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	282,433,557.36	289,585,933.01
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-69,526,135.38	-92,735,366.18
净资产合计		212,907,421.98	196,850,566.83
负债和净资产总计		215,623,347.21	199,031,513.09

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.7538 元，基金份额总额 282,433,557.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰信优质生活混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		23,321,279.92	-54,696,599.87
1. 利息收入		65,554.73	102,867.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	65,554.73	102,867.47
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）		14,631,483.68	-65,594,458.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	13,902,461.88	-67,020,265.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	729,021.80	1,425,807.09
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	6.4.7.16	8,609,279.60	10,785,829.27

失以“-”号填列)			
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	14,961.91	9,161.46
<b>减: 二、营业总支出</b>		1,913,918.41	2,628,607.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,553,288.56	2,160,092.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	258,881.48	360,015.49
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	101,748.37	108,498.96
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		21,407,361.51	-57,325,207.14
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		21,407,361.51	-57,325,207.14
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		21,407,361.51	-57,325,207.14

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体: 泰信优质生活混合型证券投资基金

本报告期: 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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)	289,585,933.01	-	-92,735,366.18	196,850,566.83
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)	289,585,933.01	-	-92,735,366.18	196,850,566.83
三、本期增减变动额(减少以“-”	-7,152,375.65	-	23,209,230.80	16,056,855.15

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	21,407,361.51	21,407,361.51
(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)	-7,152,375.65	-	1,801,869.29	-5,350,506.36
其中: 1. 基金申购款	12,006,533.44	-	-3,273,502.22	8,733,031.22
2. 基金赎回款	-19,158,909.09	-	5,075,371.51	-14,083,537.58
(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)	282,433,557.36	-	-69,526,135.38	212,907,421.98
项目	上年度可比期间			
	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)	379,317,656.56	-	29,155,575.63	408,473,232.19
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)	379,317,656.56	-	29,155,575.63	408,473,232.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-73,319,239.90	-	-52,849,413.25	-126,168,653.15
(一)、综合收益总额	-	-	-57,325,207.14	-57,325,207.14
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	-73,319,239.90	-	4,475,793.89	-68,843,446.01

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	9,481,747.57	-	-1,035,357.04	8,446,390.53
2. 基金赎回款	-82,800,987.47	-	5,511,150.93	-77,289,836.54
(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)	305,998,416.66	-	-23,693,837.62	282,304,579.04

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：

高宇

叶振宇

顾颖

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

泰信优质生活混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 229 号《关于同意泰信优质生活股票型证券投资基金设立的批复》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《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,591,255,543.43 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(2006)第 191 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 12 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,591,662,103.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 406,559.66 份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,泰信优质生活股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为泰信优质生活混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信优质生活混合型证券投资基金基金合同》

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金组合投资的范围为:股票资产 60%-95%,债券资产 0%-35%,基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:75%×富时中国 A600 指数(原新华富时 A600 指数)+25%×富时中国国债指数(原新华富时国债指数)。

#### 6.4.2 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。

#### 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红

利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	19,981,191.77
等于：本金	19,977,215.27
加：应计利息	3,976.50
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	19,981,191.77

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 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	179,396,089.00	-	186,595,763.18	7,199,674.18
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	179,396,089.00	-	186,595,763.18	7,199,674.18

#### 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工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	25.37
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,285,045.94
其中：交易所市场	1,285,045.94

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	77,458.95
合计	1,362,530.26

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	289,585,933.01	289,585,933.01
本期申购	12,006,533.44	12,006,533.44
本期赎回（以“-”号填列）	-19,158,909.09	-19,158,909.09
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	282,433,557.36	282,433,557.36

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
上年度末	-58,955,102.50	-33,780,263.68	-92,735,366.18
本期利润	12,798,081.91	8,609,279.60	21,407,361.51
本期基金份额交易产生的变动数	1,375,322.80	426,546.49	1,801,869.29
其中：基金申购款	-2,386,154.34	-887,347.88	-3,273,502.22
基金赎回款	3,761,477.14	1,313,894.37	5,075,371.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-44,781,697.79	-24,744,437.59	-69,526,135.38

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023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	15,364.65
其他	1,425.64
合计	65,554.73

## 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	13,902,461.88
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	13,902,461.88

## 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	1,385,369,845.87
减：卖出股票成本总额	1,367,601,363.38
减：交易费用	3,866,020.61
买卖股票差价收入	13,902,461.88

## 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

## 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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

## 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	729,021.80
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	729,021.80

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	8,609,279.60
股票投资	8,609,279.60
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	8,609,279.60

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,739.66
基金转换费收入	1,222.25
合计	14,961.91

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

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

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	17,951.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	5,689.42
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	101,748.37

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期本基金控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
山东省鲁信投资控股集团有限公司（“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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,553,288.56	2,160,092.82
其中：支付销售机构的客户维护费	734,188.55	894,155.68

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数。}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	258,881.48	360,015.49

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数。}$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	19,981,191.77	48,764.44	54,492,768.34	78,176.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间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（2023 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 and 市场价格风险。

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的

信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

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

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

于 2023 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（2022 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（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 2023 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 2023 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 213,615,957.11 元，超过经确认的当日净赎回金额。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	19,981,191.77	-	-	-	19,981,191.77
结算备付金	1,842,383.29	-	-	-	1,842,383.29
存出保证金	154,267.01	-	-	-	154,267.01
交易性金融资产	-	-	-	-186,595,763.18	186,595,763.18
应收申购款	-	-	-	7,162.84	7,162.84
应收清算款	-	-	-	7,042,579.12	7,042,579.12
资产总计	21,977,842.07	-	-	-193,645,505.14	215,623,347.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,763.30	6,763.30
应付管理人报酬	-	-	-	265,599.28	265,599.28
应付托管费	-	-	-	44,266.54	44,266.54
应付清算款	-	-	-	1,036,765.85	1,036,765.85
其他负债	-	-	-	1,362,530.26	1,362,530.26
负债总计	-	-	-	2,715,925.23	2,715,925.23
利率敏感度缺口	21,977,842.07	-	-	-190,929,579.91	212,907,421.98
上年度末 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	17,142,934.74	-	-	-	17,142,934.74
结算备付金	3,367,702.21	-	-	-	3,367,702.21
存出保证金	205,466.51	-	-	-	205,466.51
交易性金融资产	-	-	-	-176,882,769.78	176,882,769.78
应收申购款	-	-	-	6,459.96	6,459.96
应收清算款	-	-	-	1,426,179.89	1,426,179.89
资产总计	20,716,103.46	-	-	-178,315,409.63	199,031,513.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,447.82	16,447.82
应付管理人报酬	-	-	-	268,125.95	268,125.95
应付托管费	-	-	-	44,687.68	44,687.68
其他负债	-	-	-	1,851,684.81	1,851,684.81
负债总计	-	-	-	2,180,946.26	2,180,946.26
利率敏感度缺口	20,716,103.46	-	-	-176,134,463.37	196,850,566.83

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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 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(2022 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 2023年6月30日		上年度末 2022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	186,595,763.18	87.64	176,882,769.78	89.86
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	186,595,763.18	87.64	176,882,769.78	89.86

#### 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		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
1. 业绩比较基准上升 5%	10,449,613.61	8,627,630.08	
2. 业绩比较基准下降 5%	-10,449,613.61	-8,627,630.08	

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	186,595,763.18	176,882,769.78
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	186,595,763.18	176,882,769.78

##### 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2023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，其公允价值与账面价值相若。

#### 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	186,595,763.18	86.54
	其中：股票	186,595,763.18	86.54

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	21,823,575.06	10.12
8	其他各项资产	7,204,008.97	3.34
9	合计	215,623,347.21	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	123,708,639.25	58.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,351,664.00	2.98
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	624,429.00	0.29
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	55,911,030.93	26.26
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	186,595,763.18	87.64

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

## 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

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	300002	神州泰岳	794,300	11,120,200.00	5.22
2	688590	新致软件	430,844	9,793,084.12	4.60
3	002472	双环传动	268,800	9,757,440.00	4.58
4	002315	焦点科技	236,900	9,476,000.00	4.45
5	603688	石英股份	82,600	9,403,184.00	4.42
6	600557	康缘药业	327,100	8,982,166.00	4.22
7	000977	浪潮信息	178,994	8,681,209.00	4.08
8	600329	达仁堂	183,956	8,257,784.84	3.88
9	300724	捷佳伟创	70,600	7,931,910.00	3.73
10	603000	人民网	263,200	7,685,440.00	3.61
11	600129	太极集团	125,100	7,442,199.00	3.50
12	688658	悦康药业	328,507	6,836,230.67	3.21
13	688025	杰普特	73,761	6,443,023.35	3.03
14	688668	鼎通科技	64,975	6,354,555.00	2.98
15	603118	共进股份	444,500	5,907,405.00	2.77
16	603496	恒为科技	276,600	5,194,548.00	2.44
17	601689	拓普集团	53,300	4,301,310.00	2.02
18	688111	金山办公	8,069	3,810,343.18	1.79
19	002126	银轮股份	215,200	3,809,040.00	1.79
20	300624	万兴科技	31,000	3,631,650.00	1.71
21	600422	昆药集团	170,400	3,530,688.00	1.66
22	600633	浙数文化	208,600	3,381,406.00	1.59
23	600732	爱旭股份	108,100	3,324,075.00	1.56
24	300751	迈为股份	18,967	3,212,630.46	1.51
25	300494	盛天网络	127,800	3,168,162.00	1.49
26	603019	中科曙光	59,300	3,018,370.00	1.42
27	001896	豫能控股	580,100	2,813,485.00	1.32
28	688223	晶科能源	199,910	2,810,734.60	1.32
29	300502	新易盛	40,000	2,718,800.00	1.28
30	000690	宝新能源	306,800	2,153,736.00	1.01
31	002995	天地在线	56,800	1,881,784.00	0.88
32	300394	天孚通信	16,600	1,773,378.00	0.83
33	300049	福瑞股份	76,800	1,766,400.00	0.83
34	000600	建投能源	179,100	1,384,443.00	0.65
35	688017	绿的谐波	5,069	823,205.60	0.39
36	300723	一品红	22,200	650,460.00	0.31
37	002624	完美世界	37,600	635,064.00	0.30
38	600976	健民集团	8,100	624,429.00	0.29
39	300459	汤姆猫	81,600	529,584.00	0.25
40	300130	新国都	14,700	416,451.00	0.20

41	688088	虹软科技	8,803	376,328.25	0.18
42	002558	巨人网络	16,300	292,259.00	0.14
43	688533	上声电子	4,441	207,527.93	0.10
44	000568	泸州老窖	700	146,699.00	0.07
45	300226	上海钢联	4,000	129,600.00	0.06
46	300548	博创科技	100	3,445.00	0.00
47	002050	三花智控	100	3,026.00	0.00
48	603806	福斯特	20	743.80	0.00
49	688095	福昕软件	1	126.38	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000977	浪潮信息	32,132,325.24	16.32
2	601360	三六零	28,303,415.00	14.38
3	601138	工业富联	27,271,579.00	13.85
4	300476	胜宏科技	22,940,608.00	11.65
5	002174	游族网络	22,902,393.36	11.63
6	300459	汤姆猫	20,892,165.00	10.61
7	603688	石英股份	20,606,483.00	10.47
8	002315	焦点科技	20,234,143.20	10.28
9	300624	万兴科技	19,206,068.00	9.76
10	002045	国光电器	19,041,215.50	9.67
11	300002	神州泰岳	18,986,244.00	9.65
12	688111	金山办公	18,932,494.56	9.62
13	300525	博思软件	18,719,035.60	9.51
14	300118	东方日升	16,514,169.53	8.39
15	603019	中科曙光	15,875,210.44	8.06
16	002236	大华股份	14,915,044.00	7.58
17	300049	福瑞股份	14,903,946.38	7.57
18	688531	日联科技	14,569,897.68	7.40
19	300418	昆仑万维	14,351,312.00	7.29
20	600079	人福医药	14,108,624.00	7.17
21	603000	人民网	14,062,723.00	7.14
22	300068	南都电源	13,295,622.60	6.75
23	002558	巨人网络	12,627,965.00	6.42
24	002812	恩捷股份	12,582,615.00	6.39
25	002472	双环传动	12,117,765.00	6.16
26	002043	兔宝宝	12,111,264.00	6.15
27	688036	传音控股	12,007,099.47	6.10
28	605168	三人行	10,807,062.00	5.49
29	002415	海康威视	10,781,870.00	5.48

30	600557	康缘药业	10,237,097.00	5.20
31	300502	新易盛	10,114,889.54	5.14
32	300426	唐德影视	10,098,852.00	5.13
33	002292	奥飞娱乐	9,840,604.86	5.00
34	300015	爱尔眼科	9,836,473.29	5.00
35	600702	舍得酒业	9,693,582.00	4.92
36	688590	新致软件	9,559,035.53	4.86
37	688235	百济神州	9,519,053.86	4.84
38	600129	太极集团	9,482,191.00	4.82
39	300364	中文在线	9,434,583.00	4.79
40	603258	电魂网络	9,429,311.00	4.79
41	300148	天舟文化	9,251,667.00	4.70
42	002126	银轮股份	9,201,160.33	4.67
43	300493	润欣科技	9,174,375.65	4.66
44	002373	千方科技	9,065,938.30	4.61
45	688658	悦康药业	9,038,587.26	4.59
46	002280	联络互动	8,769,377.00	4.45
47	002065	东华软件	8,697,404.92	4.42
48	300559	佳发教育	8,520,777.00	4.33
49	002122	汇洲智能	8,504,465.00	4.32
50	000651	格力电器	8,424,345.00	4.28
51	300393	中来股份	8,400,849.00	4.27
52	603686	福龙马	8,297,941.00	4.22
53	002709	天赐材料	8,201,763.00	4.17
54	300494	盛天网络	8,139,485.00	4.13
55	600228	返利科技	8,084,454.00	4.11
56	601877	正泰电器	7,803,161.76	3.96
57	300413	芒果超媒	7,763,847.00	3.94
58	300724	捷佳伟创	7,684,086.00	3.90
59	601900	南方传媒	7,648,079.00	3.89
60	603496	恒为科技	7,622,660.80	3.87
61	002555	三七互娱	7,543,070.00	3.83
62	300308	中际旭创	7,472,211.55	3.80
63	688223	晶科能源	7,445,218.19	3.78
64	688025	杰普特	7,415,955.43	3.77
65	001896	豫能控股	7,406,436.00	3.76
66	603222	济民医疗	7,405,190.80	3.76
67	002459	晶澳科技	7,379,587.92	3.75
68	300058	蓝色光标	7,346,401.35	3.73
69	000568	泸州老窖	7,193,542.00	3.65
70	001979	招商蛇口	7,165,779.00	3.64
71	600329	达仁堂	7,012,321.00	3.56
72	600839	四川长虹	7,003,495.00	3.56

73	002777	久远银海	6,987,112.00	3.55
74	600277	亿利洁能	6,857,059.44	3.48
75	002371	北方华创	6,657,817.00	3.38
76	002624	完美世界	6,638,300.00	3.37
77	300454	深信服	6,588,033.80	3.35
78	002623	亚玛顿	6,559,136.00	3.33
79	603806	福斯特	6,441,470.00	3.27
80	002291	遥望科技	6,373,961.00	3.24
81	600633	浙数文化	6,207,401.00	3.15
82	601689	拓普集团	6,200,222.00	3.15
83	688668	鼎通科技	6,198,305.49	3.15
84	000690	宝新能源	6,099,372.00	3.10
85	601728	中国电信	6,098,240.00	3.10
86	300059	东方财富	6,060,180.00	3.08
87	301267	华夏眼科	5,857,331.54	2.98
88	002335	科华数据	5,804,074.40	2.95
89	002860	星帅尔	5,799,948.00	2.95
90	000858	五粮液	5,781,325.00	2.94
91	600790	轻纺城	5,698,295.00	2.89
92	603118	共进股份	5,645,052.72	2.87
93	300982	苏文电能	5,547,046.00	2.82
94	600475	华光环能	5,503,262.22	2.80
95	300263	隆华科技	5,452,798.44	2.77
96	300033	同花顺	5,443,850.00	2.77
97	300723	一品红	5,335,267.00	2.71
98	600732	爱旭股份	5,324,468.00	2.70
99	000002	万科 A	5,304,390.00	2.69
100	600422	昆药集团	5,286,943.00	2.69
101	002517	恺英网络	5,260,872.00	2.67
102	601155	新城控股	5,148,529.00	2.62
103	000400	许继电气	5,092,901.22	2.59
104	002334	英威腾	4,988,946.80	2.53
105	605189	富春染织	4,980,477.00	2.53
106	300604	长川科技	4,938,941.00	2.51
107	002156	通富微电	4,818,269.00	2.45
108	600819	耀皮玻璃	4,776,151.00	2.43
109	300394	天孚通信	4,751,899.00	2.41
110	301161	唯万密封	4,630,689.00	2.35
111	002466	天齐锂业	4,519,800.00	2.30
112	688023	安恒信息	4,480,879.68	2.28
113	601858	中国科传	4,449,234.00	2.26
114	300031	宝通科技	4,422,111.00	2.25
115	002244	滨江集团	4,303,818.00	2.19

116	000960	锡业股份	4,192,993.33	2.13
117	600085	同仁堂	4,177,036.00	2.12
118	601117	中国化学	4,048,548.00	2.06
119	600771	广誉远	4,002,684.00	2.03
120	600301	华锡有色	3,958,850.00	2.01
121	000625	长安汽车	3,956,144.00	2.01
122	300274	阳光电源	3,942,414.00	2.00

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601360	三六零	29,522,611.00	15.00
2	601138	工业富联	27,744,916.00	14.09
3	300476	胜宏科技	26,195,588.72	13.31
4	300624	万兴科技	25,211,507.00	12.81
5	002174	游族网络	21,750,693.00	11.05
6	300459	汤姆猫	20,998,767.00	10.67
7	000977	浪潮信息	20,899,268.72	10.62
8	300525	博思软件	18,103,893.00	9.20
9	300418	昆仑万维	17,193,212.88	8.73
10	603688	石英股份	17,147,009.00	8.71
11	002045	国光电器	17,041,583.00	8.66
12	688111	金山办公	16,923,905.22	8.60
13	002236	大华股份	16,348,482.00	8.31
14	300118	东方日升	16,223,443.71	8.24
15	002315	焦点科技	15,738,518.00	8.00
16	300274	阳光电源	15,220,793.63	7.73
17	603019	中科曙光	13,804,105.00	7.01
18	000568	泸州老窖	13,676,132.80	6.95
19	002459	晶澳科技	13,571,752.80	6.89
20	300068	南都电源	13,302,287.24	6.76
21	600079	人福医药	13,229,542.99	6.72
22	300049	福瑞股份	13,014,605.04	6.61
23	002558	巨人网络	12,766,494.00	6.49
24	688531	日联科技	12,576,685.12	6.39
25	002812	恩捷股份	12,293,890.00	6.25
26	301391	卡莱特	12,237,414.40	6.22
27	002043	兔宝宝	12,040,953.00	6.12
28	300002	神州泰岳	11,675,401.56	5.93
29	688560	明冠新材	11,141,838.11	5.66
30	300438	鹏辉能源	10,630,141.70	5.40
31	002292	奥飞娱乐	10,629,097.00	5.40

32	600702	舍得酒业	10,493,979.00	5.33
33	002415	海康威视	10,444,315.00	5.31
34	603258	电魂网络	9,934,763.00	5.05
35	605168	三人行	9,843,037.00	5.00
36	688036	传音控股	9,834,920.61	5.00
37	688235	百济神州	9,712,032.49	4.93
38	002280	联络互动	9,683,796.55	4.92
39	601900	南方传媒	9,582,688.00	4.87
40	688072	拓荆科技	9,387,222.05	4.77
41	600228	返利科技	9,366,453.00	4.76
42	300493	润欣科技	9,319,753.00	4.73
43	002373	千方科技	9,281,567.59	4.72
44	688516	奥特维	9,078,687.40	4.61
45	000858	五粮液	9,044,959.00	4.59
46	000651	格力电器	9,040,338.00	4.59
47	300426	唐德影视	8,908,104.00	4.53
48	300015	爱尔眼科	8,790,426.24	4.47
49	600519	贵州茅台	8,786,379.57	4.46
50	300559	佳发教育	8,565,784.00	4.35
51	300364	中文在线	8,444,364.00	4.29
52	300058	蓝色光标	8,351,344.45	4.24
53	002065	东华软件	8,330,506.00	4.23
54	603686	福龙马	8,302,984.00	4.22
55	300148	天舟文化	8,200,405.00	4.17
56	600329	达仁堂	8,050,486.00	4.09
57	300413	芒果超媒	7,954,987.00	4.04
58	002965	祥鑫科技	7,943,067.26	4.04
59	002517	恺英网络	7,940,416.00	4.03
60	300308	中际旭创	7,919,589.00	4.02
61	002709	天赐材料	7,841,626.00	3.98
62	002371	北方华创	7,754,967.00	3.94
63	603806	福斯特	7,749,626.00	3.94
64	601877	正泰电器	7,621,017.00	3.87
65	300393	中来股份	7,613,446.00	3.87
66	603222	济民医疗	7,376,919.84	3.75
67	002555	三七互娱	7,346,730.00	3.73
68	002122	汇洲智能	7,334,745.00	3.73
69	001979	招商蛇口	7,301,104.95	3.71
70	300573	兴齐眼药	7,217,386.00	3.67
71	300502	新易盛	7,136,629.00	3.63
72	002518	科士达	6,974,204.46	3.54
73	600277	亿利洁能	6,925,688.00	3.52
74	600839	四川长虹	6,809,114.00	3.46

75	300454	深信服	6,467,289.00	3.29
76	002623	亚玛顿	6,361,675.99	3.23
77	601728	中国电信	6,251,183.00	3.18
78	688099	晶晨股份	6,049,991.30	3.07
79	300494	盛天网络	6,005,385.00	3.05
80	688120	华海清科	5,955,700.22	3.03
81	002777	久远银海	5,864,769.00	2.98
82	002291	遥望科技	5,844,336.00	2.97
83	300059	东方财富	5,813,473.00	2.95
84	600475	华光环能	5,801,527.00	2.95
85	002126	银轮股份	5,706,814.00	2.90
86	002624	完美世界	5,695,235.00	2.89
87	603000	人民网	5,662,362.00	2.88
88	688381	帝奥微	5,610,497.50	2.85
89	002860	星帅尔	5,538,993.00	2.81
90	300982	苏文电能	5,459,164.00	2.77
91	002334	英威腾	5,453,556.16	2.77
92	300723	一品红	5,435,044.00	2.76
93	000002	万 科 A	5,411,205.00	2.75
94	000400	许继电气	5,394,041.00	2.74
95	300033	同花顺	5,355,619.00	2.72
96	301267	华夏眼科	5,258,104.14	2.67
97	002335	科华数据	5,196,414.00	2.64
98	300031	宝通科技	5,079,352.00	2.58
99	600790	轻纺城	5,060,703.00	2.57
100	601155	新城控股	5,018,251.00	2.55
101	002156	通富微电	4,932,697.86	2.51
102	688223	晶科能源	4,907,705.28	2.49
103	601858	中国科传	4,774,947.00	2.43
104	300263	隆华科技	4,754,528.00	2.42
105	300394	天孚通信	4,739,547.00	2.41
106	605189	富春染织	4,721,307.00	2.40
107	300604	长川科技	4,649,154.00	2.36
108	688599	天合光能	4,537,889.30	2.31
109	688023	安恒信息	4,456,133.39	2.26
110	002244	滨江集团	4,453,355.00	2.26
111	001896	豫能控股	4,353,138.00	2.21
112	600200	江苏吴中	4,350,199.00	2.21
113	605117	德业股份	4,288,057.00	2.18
114	600771	广誉远	4,255,582.00	2.16
115	688008	澜起科技	4,245,407.03	2.16
116	688435	英方软件	4,239,906.86	2.15
117	300633	开立医疗	4,217,606.15	2.14

118	600819	耀皮玻璃	4,169,275.00	2.12
119	002466	天齐锂业	4,145,271.00	2.11
120	600522	中天科技	4,110,901.00	2.09
121	601117	中国化学	4,064,589.00	2.06
122	600085	同仁堂	4,047,594.00	2.06
123	000960	锡业股份	4,019,517.00	2.04
124	603456	九洲药业	3,953,389.00	2.01

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,368,705,077.18
卖出股票收入（成交）总额	1,385,369,845.87

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

#### 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

报告期末本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末本基金未投资贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末本基金未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

### 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	154,267.01
2	应收清算款	7,042,579.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,162.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,204,008.97

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有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

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
13,261	21,298.06	2,654,445.10	0.94	279,779,112.26	99.06

### 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	11.13	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、基金投资和研发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（2006 年 12 月 15 日） 基金份额总额	1,591,662,103.09
本报告期期初基金份额总额	289,585,933.01
本报告期基金总申购份额	12,006,533.44
减：本报告期基金总赎回份额	19,158,909.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	282,433,557.36

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金管理人的重大人事变动。

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

### 10.6.1 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。

### 10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

## 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 (%)	
华福证券	2	366,618,269.18	13.31	268,109.17	11.84	-
财通证券	2	343,592,223.99	12.48	251,268.84	11.10	-
西南证券	1	276,155,176.20	10.03	257,185.79	11.36	-
国金证券	1	247,614,109.44	8.99	228,129.11	10.08	-
天风证券	2	186,176,141.78	6.76	136,151.47	6.01	-
首创证券	1	158,749,332.87	5.76	116,093.41	5.13	-
德邦证券	1	156,027,142.62	5.67	114,102.55	5.04	-
中邮证券	2	155,947,121.70	5.66	114,044.62	5.04	-
东方证券	1	146,331,206.01	5.31	134,815.12	5.96	-
海通证券	4	146,191,057.88	5.31	134,685.77	5.95	-
申万宏源	1	126,177,705.92	4.58	117,509.40	5.19	-
招商证券	1	123,144,054.85	4.47	113,452.89	5.01	-
浙商证券	1	94,603,923.46	3.44	86,212.03	3.81	-
国盛证券	1	88,350,331.67	3.21	64,610.89	2.85	-
安信证券	3	77,218,564.3	2.80	71,141.12	3.14	-

		3				
国海证券	1	61,178,561.15	2.22	56,364.17	2.49	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	3	-	-	-	-	-
甬兴证券	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，对席位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：华福证券上海 57357、华福证券深圳 016637、甬兴证券上海 55851、甬兴证券深圳 001296、广发证券上海 58189、广发证券深圳 016705；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(%)
华福证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证	-	-	-	-	-	-

券						
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

甬兴证 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	关于旗下部分开放式基金新增博时财富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业务的公告	《证券日报》、规定网站	2023 年 1 月 12 日
2	关于旗下部分开放式基金新增博时财富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业务的公告	《证券日报》、规定网站	2023 年 1 月 16 日
3	泰信优质生活混合型证券投资基金 2022 年 4 季度报告	《证券日报》、规定网站	2023 年 1 月 19 日
4	关于旗下部分开放式基金在中信证券、中信证券（山东）、中信证券华南参加其费率优惠活动的公告	《证券日报》、规定网站	2023 年 3 月 6 日
5	泰信优质生活混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 1 号）、产品资料概要更新	《证券日报》、规定网站	2023 年 3 月 11 日
6	泰信优质生活混合型证券投资基金 2022 年年度报告	《证券日报》、规定网站	2023 年 3 月 30 日
7	泰信优质生活混合型证券投资基金 2023 年 1 季度报告	《证券日报》、规定网站	2023 年 4 月 21 日
8	关于旗下部分开放式基金在中信期货有限公司参加费率优惠活动的公告	《证券日报》、规定网站	2023 年 5 月 12 日
9	关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司参加费率优惠活动的公告	《证券日报》、规定网站	2023 年 5 月 26 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信优质生活股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信优质生活混合型证券投资基金基金合同》

- 3、《泰信优质生活混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信优质生活混合型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、报告期内本基金在规定媒介对外披露的各项公告

## 12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人住所（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

投资者可登录本基金管理人公司网站(<http://www.ftfund.com>)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988, 021-38784566)，和本公司客服联系。

泰信基金管理有限公司

2023年8月30日