泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2019年8月24日

§1 重要提示

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	泰信基本面400指数分级		
场内简称	泰信400		
基金主代码	162907		
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)		
基金合同生效日	2012年9月7日		
基金管理人	泰信基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	45,948,141.02份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年9月21日		
下属分级基金的基金简称	泰信基本面400A	泰信基本面400B	泰信基本面400
下属分级基金场内简称:	泰信400A	泰信400B	泰信400
下属分级基金的交易代码	150094	150095	162907
报告期末下属分级基金份额总额	1,063,479.00份	1,063,479.00份	43,821,183.02份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金主要采用完全复制法,按照在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。		
业绩比较基准	95%×中证锐联基本面400指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期收益。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	郭明
	联系电话	021-20899098	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	(010)66105798

2.4信息披露方式

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

§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(2019年1月1日 – 2019年6月30日)
本期已实现收益	-2,761,873.66
本期利润	6,932,648.74
加权平均基金份额本期利润	0.1497
本期基金份额净值增长率	17.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2905
期末基金资产净值	44,296,030.97
期末基金份额净值	0.964

1、本基金基金合同于2012年9月7日正式生效。

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

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

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2基金净值表现

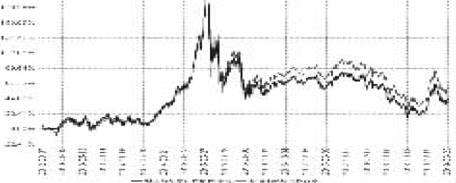
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.73%	1.25%	0.61%	1.28%	0.12%	-0.03%
过去三个月	-8.80%	1.67%	-9.55%	1.70%	0.75%	-0.03%
过去六个月	17.85%	1.64%	18.69%	1.68%	-0.84%	-0.04%
过去一年	-1.77%	1.55%	-1.10%	1.58%	-0.67%	-0.03%
过去三年	-10.43%	1.21%	-6.51%	1.23%	-3.92%	-0.02%
自基金合同生效起至今	42.94%	1.63%	59.03%	1.66%	-16.09%	-0.03%

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

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

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



1、本基金基金合同于2012年9月7日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满,基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面400指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%;现金以及到期日在1年以内的政府债券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号华夏银行大厦37层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区浦东南路256号华夏银行大厦36-37层
成立日期:2003年5月23日
法定代表人:万众
总经理:葛航
电话:021-20899188
传真:021-20899008
联系人:姚慧
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日经中国证券监督委员会批准正式筹建,2003年5月8日获准开业,是以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、产品部、营销部(分华东、华北、华南三大营销中心)、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、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2019年6月底,公司有正式员工97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2019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、泰信中证基本面400指数分级、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、泰信鑫利混合、泰信竞争优选共21只开放式基金及14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		
张彦先生	本基金经理兼泰信中证200指数基金、泰信智选成长混合基金经理	2015年1月6日	–	13年	研究生硕士。具有基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011年6月加入泰信基金管理有限公司,担任高级研究员。自2011年10月至2014年5月任泰信中小盘精选基金经理助理。2012年4月至2015年1月任泰信优势增长混合基金经理助理。自2015年1月6日起同时担任泰信中证200指数基金经理;自2017年11月15日起担任泰信智选成长混合基金经理。

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行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2异常交易行为的专项说明

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

4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年全球经济疲软将迫使全球央行货币政策由紧转松提速,推动全球风险偏好回暖,而国内资本市场顶层政策定位提升也较大修复了投资者 18 年以来低迷情绪,但是中美贸易战一波三折不断反复,也导致市场先扬后抑,上半年上证综指上涨19.45%,中小板上涨203.75%,创业板上涨20.87%。

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

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.964元;本报告期基金份额净值增长率为17.85%,业绩比较基准收益率为18.69%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济共振下行仍然是预期之内的风险,中美两国通胀的高位回落也会大概率发生,这为全球货币政策的进一步宽松打开了窗口。美国经济产出缺口由正转负并进一步扩大,将对美元指数构成阶段性压力。库存周期寻底之旅决定A股趋势,流动性宽松有望带来结构性反弹行情。

展望下半年,基数效应有望为A股全年盈利水平带来正贡献,量价下行压力下营收企稳仍存在较大压力。下半年市场或仍将经历基本面数据及中美贸易走势的不确定性带来的阶段性风险偏好冲击，市场机会或来自于估值回落后内部对冲政策的释放带来的风险偏好抬升以及系统性风险释放后,部分逆周期行业盈利触底回升带来的估值修复机会。

从长期大国博弈的角度看,经济长期竞争力将决定资本市场的大趋势。中国保持战略定力,坚持供给侧改革和改革开放,经济转型高质量发展将利在长远。中国的调结构将带来核心资产的重估。科创板赋予了资本市场重新定位,长期来看中国的权益市场迎来战略新机遇。

作为指数分级型基金产品,我们将坚持指数化投资策略,严格控制基金相对目标指数(基本面400指数)的偏离度,跟踪市场趋势,使得投资者可以清晰地把握分级子基金的交易情况,把握住投资时机。本基金将继续规范运作,审慎投资,勤勉尽责地维护基金份额持有人利益。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生,本科学历。2002年加入泰信基金管理公司,现任公司副总经理。

委员会成员:

王译晨女士,硕士。2019年加入泰信基金管理有限公司,现任公司风险管理部总监助理。

蔡海成先生,硕士。2013年加入泰信基金管理有限公司,现任公司清算会计部总监。

朱志权先生,学士。2008年6月加入泰信基金管理有限公司,现任基金投资部总监兼投资总监,泰信优势增长混合基金、泰信智选成长混合基金经理。

梁剑先生,硕士。2004年7月加入泰信基金管理有限公司,现任研究部副总监兼研究副总监。

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在基金存续期内,本基金(包括泰信基本面400份额、泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额)不进行收益分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金于2019年1月2日至2019年3月29日、2019年4月25日至2019年6月28日有连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。我公司已向中国证监会报送泰信基本面400指数分级基金申请转型解决方案。

§5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	4,131,621.41	3,258,492.88
结算备付金	–	–
存出保证金	244.06	428.57
交易性金融资产	40,332,780.76	35,087,668.86
其中:股票投资	40,332,780.76	35,087,668.86
基金投资	–	–
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	729.15	648.76
应收股利	–	–
应收申购款	499.40	3,795.44
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	44,465,874.78	38,351,034.51
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	–	–
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	35,877.07	33,545.18
应付托管费	7,892.95	7,379.95
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	31,051.39	322.76
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	95,022.40	190,030.19
负债合计	169,843.81	231,278.08
所有者权益:		
实收基金	30,946,315.35	31,408,921.19
未分配利润	13,349,715.62	6,710,835.24
所有者权益合计	44,296,030.97	38,119,756.43
负债和所有者权益总计	44,465,874.78	38,351,034.51

报告截止日2019年6月30日,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之基础份额净值0.964元,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之A份额净值1.024元,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之B份额净值0.904元;基金份额总额45,948,141.02份,其中泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之基础份额43,821,183.02份,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之A份额1,063,479.00份,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之B份额1,063,479.00份。

6.2利润表

会计主体:泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	7,369,227.28	-8,135,980.58
1.利息收入	11,532.95	12,357.95
其中:存款利息收入	11,532.95	12,357.95
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	–	–
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)	-2,339,934.02	467,917.17
其中:股票投资收益	-2,870,005.73	-21,625.53
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	–
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	530,071.71	489,542.70
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	9,694,522.40	-8,621,753.44
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)	3,105.95	5,497.74
减:二、费用	436,578.54	521,842.55
1.管理人报酬	221,358.39	267,060.52
2.托管费	48,698.84	58,753.31
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	51,716.02	41,088.54
5.利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6.税金及附加	–	–
7.其他费用	114,805.29	154,940.18
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	6,932,648.74	-8,657,823.13
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	6,932,648.74	-8,657,823.13

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	31,408,921.19	6,710,835.24	38,119,756.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	6,932,648.74	6,932,648.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-462,605.84	-293,768.36	-756,374.20
其中:1.基金申购款	825,316.41	402,930.71	1,228,247.12
2.基金赎回款	-1,287,922.25	-696,699.07	-1,984,621.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	30,946,315.35	13,349,715.62	44,296,030.97
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	32,997,977.88	23,780,348.07	56,778,325.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-8,657,823.13	-8,657,823.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,909,011.12	-946,106.37	-2,855,117.49
其中:1.基金申购款	574,926.55	306,398.43	881,324.98
2.基金赎回款	-2,483,937.67	-1,252,504.80	-3,736,442.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	31,088,966.76	14,176,418.57	45,265,385.33

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:

葛航	韩波	蔡海成
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金(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[2012]第252号《关于核准泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金募集的批复》核准,由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约开放型,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币300,797,873.45元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第346号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》于2012年9月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为300,843,720.90份,其中认购资金利息折合45,847.45份。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“泰信基本面400份额”)、泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“泰信基本面400A份额”)与泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“泰信基本面400B份额”)。其中,泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额的基金份额配比始终保持1:1的比率不变。

根据《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》的规定,每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日为基金份额折算基准日,本基金将对泰信基本面400A份额和泰信基本面400份额进行应得收益的定期份额折算。泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行参考净值计算,对泰信基本面400A份额的应得收益进行定期份额折算,每2份泰信基本面400份额将按1份泰信基本面400A份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后,泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额的份额配比保持1:1的比例。对于泰信基本面400A份额期末的约定应得收益,即泰信基本面400A份额每个会计年度12月31日份额参考净值超出1.000元部分，将折算为场内泰信基本面400份额分配给泰信基本面400A份额持有人。泰信基本面400份额持有人持有的每2份泰信基本面400份额将按1份泰信基本面400A份额获得新增泰信基本面400份额的分配。持有场外泰信基本面400份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰信基本面400份额的分配;持有场内泰信基本面400份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰信基本面400份额的分配。经过上述份额折算，泰信基本面400A份额的基金份额参考净值和泰信基本面400份额的基金份额净值将相应调整。

除以上定期份额折算外,本基金根据基金合同规定,还将在以下两种情况进行份额折算,即:当泰信基本面400份额的基金份额净值达到2.000元;当泰信基本面400B份额的基金份额参考净值达到0.250元。当泰信基本面400份额的基金份额净值达到2.000元后,本基金将分别对泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额和泰信基本面400份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额的比例为1:1，份额折算后泰信基本面400份额的基金份额净值、泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额的基金份额参考净值均调整为1元。当泰信基本面400B份额的基金份额参考净值达到0.250元后,本基金将分别对泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额和泰信基本面400份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额的比例为1:1,份额折算后泰信基本面400份额的基金份额净值、泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额的基金份额参考净值均调整为1.000元。

泰信基本面400份额设置单独的基金代码,但不上市交易。泰信基本面400A份额与泰信基本面400B份额交易代码不同,只可在深圳证券交易所(以下简称“深交所”)上市交易,不可单独进行申购或赎回。投资者可在场内申购和赎回泰信基本面400份额,投资者可选择将其场内申购的泰信基本面400份额按1:1的比例分拆成泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额,投资者可按1:1的配比将其持有的泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额申请合并为泰信基本面400份额后赎回。投资者可在场外申购和赎回泰信基本面400份额。场外申购的泰信基本面400份额不进行分拆。投资者可将其持有的场外泰信基本面400份额跨系统转登记至场内并申请将其分拆成泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额后上市交易。投资者可按1:1的配比将其持有的泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额合并为泰信基本面400份额后赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券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。其中,中证锐联基本面400指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的标的指数是中证锐联基本面400指数。本基金的业绩比较基准是95%×中证锐联基本面400指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)。

6.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4重要会计政策和会计估计

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报告一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
山东省国际信托股份有限公司(“山东国托”)	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(“青岛国信”)	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未进行关联交易。

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5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未有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	221,358.39	267,060.52
其中:支付销售机构的客户维护费	25,832.08	28,838.45

支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	48,698.84	58,753.31

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.22% / 当年天数。

6.4.8.2.3销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间未发生销售服务费用。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1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 2019年1月1日至2019年6月30日		
	泰信基本面400A	泰信基本面400B	泰信基本面400
期初持有的基金份额	–	–	15,373,590.89
期间申购/买入总份额	–	–	0.00
期间因拆分变动份额	–	–	249,176.89
减:期间赎回/卖出总份额	–	–	300,000.00
期末持有的基金份额	–	–	15,322,767.78
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–	33.3500%
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	泰信基本面400A	泰信基本面400B	泰信基本面400
期初持有的基金份额	–	–	24,010,861.29
期间申购/买入总份额	–	–	0.00
期间因拆分变动份额	–	–	-8,637,270.40
减:期间赎回/卖出总份额	–	–	0.00
期末持有的基金份额	–	–	15,373,590.89
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–	33.8400%

1、依据《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金招募说明书》相关约定,持有时间2年以上(含2年)不收取赎回费用。

2、基金管理人泰信基金管理有限公司在本期赎回本基金的交易委托泰信直销办理。

6.4.8.4.2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

份额单位:份

泰信基本面400				
关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山东省国际信托股份有限公司	18,936,790.03	41.2100%	18,634,755.83	40.6100%

6.4.8.5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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	4,131,621.41	11,530.43	4,635,337.93	11,754.52

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6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未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	*ST信威	2016年12月26日	重大事项	6.28	2019年7月12日	13.86	4,762	88,204.18	29,905.36	–

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事正回购交易作为抵押的债券。

6.4.10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	40,332,780.76	90.71
	其中:股票	40,332,780.76	90.71
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	4,131,621.41	9.29
8	其他各项资产	1,472.61	0.00
9	合计	44,465,874.78	100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1期末指数投资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	232,432.85	0.52
B	采矿业	1,989,400.05	4.49
C	制造业	22,472,452.73	50.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	925,210.02	2.09
E	建筑业	1,306,215.73	2.95
F	批发和零售业	3,119,904.60	7.04
G	交通运输、仓储和邮政业	2,157,944.12	4.87
H	住宿和餐饮业	61,994.24	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,201,877.47	2.71
J	金融业	2,645,067.59	5.97
K	房地产业	2,544,507.48	5.74
L	租赁和商务服务业	724,178.70	1.63
M	科学研究和技术服务业	17,336.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	248,738.07	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	55,746.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	599,869.75	1.35
S	综合	–	–
	合计	40,302,875.40	90.99

7.2.2期末积极投资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	29,905.36	0.07
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	29,905.36	0.07

积极投资股票为被动持有非当前成分股,将逐步进行调整成分股。

7.2.3报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票。

7.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	3,917	258,522.00	0.58
2	000413	东旭光电	49,603	254,959.42	0.58
3	000039	中集集团	23,280	248,630.40	0.56
4	600109	国金证券	25,478	247,646.16	0.56
5	600100	同方股份	26,800	242,540.00	0.55
6	601233	桐昆股份	15,559	241,320.09	0.54
7	000488	晨鸣纸业	44,550	238,788.00	0.54
8	600418	江淮汽车	45,700	235,812.00	0.53
9	600522	中天科技	25,587	234,632.79	0.53
10	002183	怡亚通	46,183	220,292.91	0.50

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

7.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600485	*ST信威	4,762	29,905.36	0.07

积极投资股票为被动持有非当前成分股,将逐步进行调整成分股。

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	600100	同方股份	253,528.00	0.67
2	000039	中集集团	249,290.00	0.65
3	600418	江淮汽车	239,925.00	0.63
4	600276	恒瑞医药	214,060.10	0.56
5	601333	广深铁路	199,838.00	0.52
6	600166	福田汽车	196,419.00	0.52
7	600664	哈药股份	187,454.00	0.49
8	600528	中铁工业	173,544.00	0.46
9	000413	东旭光电	172,608.00	0.45
10	000878	云南铜业	169,938.00	0.45
11	601233	桐昆股份	169,651.00	0.45
12	000066	中国长城	168,702.00	0.44
13	000983	西山煤电	167,835.00	0.44
14	601901	方正证券	167,772.00	0.44
15	600522	中天科技	161,955.00	0.42
16	600717	天津港	153,520.00	0.40
17	600307	酒钢宏兴	150,800.00	0.40
18	603858	步长制药	146,308.00	0.38
19	601168	西部矿业	140,563.00	0.37
20	600369	西南证券	140,400.00	0.37

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

7.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002157	正邦科技	324,567.64	0.85
2	601555	东吴证券	272,260.95	0.71
3	601997	贵阳银行	241,412.22	0.63
4	000550	江铃汽车	231,691.33	0.61
5	000401	冀东水泥	230,991.84	0.61
6	601168	西部矿业	218,883.91	0.57
7	601099	太平洋	216,759.60	0.57
8	002092	中泰化学	196,685.35	0.52
9	300226	上海钢联	192,358.90	0.50
10	000961	中南建设	190,435.86	0.50
11	600276	恒瑞医药	178,358.82	0.47
12	600522	中天科技	171,461.85	0.45
13	000728	国元证券	162,752.04	0.43
14	000671	阳光城	162,285.73	0.43
15	000703	恒逸石化	160,274.00	0.42
16	600782	新钢股份	152,768.00	0.40
17	601012	隆基股份	148,836.78	0.39
18	600039	四川路桥	145,519.66	0.38
19	000600	建投能源	141,453.93	0.37
20	600067	冠城大通	139,441.56	0.37

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	16,242,396.24
卖出股票收入(成交)总额	17,821,801.01

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

本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

本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前十名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报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

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报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.3本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.12投资组合报告附注

7.12.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	244.06
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	729.15
5	应收申购款	499.40
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,472.61

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

7.12.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名中不存在流通受限情况。

7.12.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	*ST信威	29,905.36	0.07	重大事项

7.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§8基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰信基本面400A	59	18,025.07	0.00	0.00%	1,063,479.00	100.00%
泰信基本面400B	371	2,866.52	108.00	0.01%	1,063,371.00	99.99%
泰信基本面400	503	87,119.65	34,262,456.81	78.19%	9,558,726.21	21.81%
合计	933	49,247.74	34,262,564.81	74.57%	11,685,576.21	25.43%

8.2期末上市基金前十名持有人

泰信基本面400A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	蔡小婉	207,066.00	19.47%
2	李惠莲	168,400.00	15.83%
3	余志胜	110,546.00	10.39%
4	高明桂	90,000.00	8.46%
5	吴益群	83,604.00	7.86%
6	孙林红	70,237.00	6.60%
7	刘辉荣	53,900.00	5.07%
8	赖明理	44,000.00	4.14%
9	吕谷城	42,400.00	3.99%
10	谢晋龙	36,100.00	3.39%

泰信基本面400B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	韩莉颖	307,125.00	28.88%
2	杨一木	59,956.00	5.64%
3	李建灵	43,300.00	4.07%
4	吉庆伍	38,094.00	3.58%
5	张仁仓	36,000.00	3.39%
6	张建斌	23,349.00	2.20%
7	崔文涛	22,428.00	2.11%
8	王方	19,539.00	1.84%
9	孙丽君	16,713.00	1.57%
10	包素芹	15,700.00	1.48%

8.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

8.4期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰信基本面400A	0
	泰信基本面400B	0
	泰信基本面400	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰信基本面400A	0
	泰信基本面400B	0
	泰信基本面400	0
	合计	0

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

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰信基本面400A	泰信基本面400B	泰信基本面400
基金合同生效日(2012年9月7日)基金份额总额	–	–	300,843,720.90
本报告期期初基金份额总额	905,303.00	905,303.00	44,080,767.84
本报告期期间基金总申购份额	–	–	1,225,308.64
减:本报告期期间基金总赎回份额	–	–	1,912,387.95
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	158,176.00	158,176.00	427,494.49
本报告期期末基金份额总额	1,063,479.00	1,063,479.00	43,821,183.02

§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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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,仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
川财证券	1	18,855,217.21	55.96%	17,559.67	56.49%	–
广发证券	2	14,839,905.31	44.04%	13,523.73	43.51%	–
广州证券	1	–	–	–	–	–
东北证券	1	–	–	–	–	–
渤海证券	1	–	–	–	–	–
瑞银证券	1	–	–	–	–	–
国盛证券	1	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
民生证券	1	–	–	–	–	–
国信证券	2	–	–	–	–	–
新时代证券	2	–	–	–	–	–
华创证券	2	–	–	–	–	–
天风证券	1	–	–	–	–	–
中银国际	1	–	–	–	–	–
申万宏源	2	–	–	–	–	–
东兴证券	1	–	–	–	–	–
中泰证券	1	–	–	–	–	–
中山证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
高华证券	1	–	–	–	–	–
中国银河证券	1	–	–	–	–	–

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:无;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
川财证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
渤海证券	–	–	–	–	–	–
瑞银证券	–	–	–	–	–	–
国盛证券	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
新时代证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–
中泰证券	–	–	–	–	–	–
中山证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
高华证券	–	–	–	–	–	–
中国银河证券	–	–	–	–	–	–

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101 – 20190630	18,634,755.83	302,034.20	0.00	18,936,790.03	41.21%
	2	20190101 – 20190630	15,373,590.89	249,176.89	300,000.00	15,322,767.78	33.35%
个人	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,本基金管理人已经采取措施,审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

泰信基金管理有限公司
2019年8月24日