泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金

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	泰信国策驱动混合
基金主代码	001569
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年10月27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	154,686,177.85份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金将积极投资于受益于国家政策驱动、符合经济发展方向且具有良好成长性的优质企业，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	我国经济转型的推进与国家政策导向紧密相关，国家政策将有力推动相关经济领域的发展，受益于国家政策的行业和公司将成为先导性力量，在整体经济中占主导地位，其中蕴含的投资机会将主导未来资本市场的走向。 本基金将深入挖掘国家政策驱动、符合经济发展方向且确定性较高的投资机会，同时结合"自上而下"的资产配置策略和"自下而上"的个股精选策略，注重股票资产在其各相关行业的配置，并考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产波动的风险。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国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	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	9,727,464.37
本期利润	17,237,023.78
加权平均基金份额本期利润	0.1076
本期基金份额净值增长率	20.43%
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	-0.3866
期末基金资产净值	94,883,292.39
期末基金份额净值	0.613

1、本基金基金合同于2015年10月27日正式生效。

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	-3.01%	1.61%	2.92%	0.59%	-5.93%	1.02%
过去三个月	-9.19%	1.96%	-0.06%	0.77%	-9.13%	1.19%
过去六个月	20.43%	1.92%	14.27%	0.78%	6.16%	1.14%
过去一年	-7.82%	1.74%	7.61%	0.76%	-15.43%	0.98%
过去三年	-29.54%	1.44%	16.79%	0.56%	-46.33%	0.88%
自基金合同生效起至今	-38.70%	1.43%	12.03%	0.63%	-50.73%	0.80%

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2015年10月27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:股票资产占基金资产的0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期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		
车广路先生	本基金经理兼泰信蓝筹精选基金经理	2015年10月27日	-	12年	工商管理学硕士。具有基金从业资格。2007年6月进入泰信基金管理有限公司，历任研究部研究员、高级研究员、泰信蓝筹精选基金经理助理。自2012年3月1日至2014年6月21日担任泰信蓝筹精选基金经理;自2014年6月21日至2016年1月27日担任泰信发展主题基金经理;自2015年2月5日开始担任泰信蓝筹精选基金经理。

1、基金经理的任职日期以基金合同生效日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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》、《泰信国策驱动灵活配置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律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、交易各环节规范监控，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年开年以来，受中美贸易摩擦缓解、美联储加息步伐减缓、国内市场流动性环境宽松等一系列利好的影响，市场风险偏好快速提升，A股市场出现大幅上涨。在2月公布的1月信贷数据大超市场预期和MSCI扩容的推动下，行情贯穿了整个1季度，所有中信一级行业都取得了15%以上的涨幅。4月上半月市场延续了一季度以来的上涨趋势，并创出本轮反弹的新高。4月下旬开始到6月下旬，受中美政局局会议再提去杠杆和中美贸易摩擦再次升级的影响，市场出现了较大幅度的调整。6月下旬开始在贸易摩擦缓和消息的影响下市场再次出现反弹。在市场调整过程中，前期表现较好的成长股和养殖股出现较大幅度的调整，而随着避险情绪的上升大消费和大金融板块则表现较好。从具体行业来看，上半年非银行金融和食品饮料行业表现较好，而汽车、传媒和建筑行业表现较差。本基金在上半年重点持有了养殖、计算机和通讯等科技行业的股票。

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0.613元;本报告期基金份额净值增长率为20.43%，业绩比较基准收益率为14.27%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于2019年下半年经济，7月底政治局会议，专门提出"不将房地产作为短期刺激经济的手段"，同时，会议强调坚持以供给侧改革为主线，推动高质量发展，我们预计下半年整体政策将保持定力不搞逆周期的强刺激政策，随着房地产企业的非标和信托融资有所收紧，房地产销售逐步回落，新开工将逐步下滑，施工投资将回升，整个房地产投资预计将缓慢下行。

随着美国对2500亿美元贸易清单25%的关税将在下半年逐渐显现出影响，对美出口预计降幅有继续扩大可能，全球贸易摩擦加剧，使得整个出口有收缩风险，制造业PMI预计延续下滑。

政治局会议重提六稳，财政政策要加力提效，预计下半年基建方面将有一定程度回升。总体，我们预计下半年经济仍存下行压力但不会失速下降。

随着美联储和其他国家央行的依次降息，我国在货币政策方面将有更多的宽松空间，政治局会议定调流动性合理充裕，我们预计下半年货币政策较二季度宽松。财政政策方面，预计下半年继续坚持减税降费的积极财政政策，托底经济，通过改革释放发展活力保证经济增长质量。

对当前市场的判断，我们认为中美贸易摩擦将是一个长期问题，不是短时间能够解决的，贸易谈判的反复影响市场短期的风险偏好，而真正影响市场方向的还是国内的经济基本面和政策改革。政治局会议定调流动性合理充裕，另外MSCI8月预计大概率将A股权重上调，外资配置A股市场比例逐渐加大，国内市场的增量资金将越来越多，中长期我们相对看好市场。

短期看，市场处于经济基本面向下寻底，风险偏好受到中美贸易战影响波动较大，货币政策偏宽松，我们重点关注以下几个方向的投资机会:能对抗经济周期回落的行业如养殖、光伏和新能源汽车行业，以及景气度有望改善或者正在改善的代表未来发展方向的科技板块，主要包括云计算和5G相关行业;最后大金融和大消费板块的防御价值也值得关注。

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:

王泽晨女士，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

一、基金合同关于利润分配的约定

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红;

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

4、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。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

本报告期内，本基金托管人在对泰信国策驱动灵活配置混合型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，泰信国策驱动灵活配置混合灵活配置混合型证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信国策驱动灵活配置混合灵活配置混合型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。本报告期内，泰信国策驱动灵活配置混合灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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国策驱动灵活配置混合灵活配置混合型证券投资基金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:泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金
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	6,724,778.56	25,071,494.03
结算备付金	316,697.89	440,104.62
存出保证金	92,684.69	97,232.21
交易性金融资产	88,305,450.00	59,539,437.20
其中:股票投资	88,305,450.00	59,539,437.20
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	7,388.95	-
应收利息	1,459.48	4,891.28
应收股利	-	-
应收申购款	9,951.12	119.84
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	95,458,410.69	85,153,279.18
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	46,738.53	-
应付赎回款	33,435.40	4,017.96
应付管理人报酬	116,126.77	111,183.50
应付托管费	19,354.47	18,530.56
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	273,264.65	271,159.28
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	86,198.48	340,011.28
负债合计	575,118.30	744,902.58
所有者权益:		
实收基金	154,686,177.85	165,867,585.68
未分配利润	-59,802,885.46	-81,459,209.08
所有者权益合计	94,883,292.39	84,408,376.60
负债和所有者权益总计	95,458,410.69	85,153,279.18

报告截止日2019年6月30日，基金份额净值0.613元，基金份额总额154,686,177.85份。

6.2利润表

会计主体:泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金
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	19,165,986.23	-12,628,595.75
1.利息收入	55,159.75	75,550.51
其中:存款利息收入	55,159.75	75,550.51
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)	11,577,671.79	-5,390,098.67
其中:股票投资收益	11,029,997.82	-5,702,655.48
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	547,673.97	312,556.81
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7,509,559.41	-7,316,745.49
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	23,595.28	2,697.90
减:二、费用	1,928,962.45	2,644,711.09
1. 管理人报酬	726,573.05	1,014,131.74
2. 托管费	121,095.54	169,021.95
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	985,786.49	1,292,633.90
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	95,507.37	168,923.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	17,237,023.78	-15,273,306.84
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	17,237,023.78	-15,273,306.84

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金
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)	165,867,585.68	-81,459,209.08	84,408,376.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,237,023.78	17,237,023.78
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)	-11,181,407.83	4,419,299.84	-6,762,107.99
其中:1.基金申购款	7,247,506.62	-2,434,184.88	4,813,321.74
2.基金赎回款	-18,428,914.45	6,853,484.72	-11,575,429.73
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)	154,686,177.85	-59,802,885.46	94,883,292.39
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)	205,806,725.63	-52,203,809.43	153,602,916.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,273,306.84	-15,273,306.84
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)	-35,626,853.30	10,487,521.65	-25,139,331.65
其中:1.基金申购款	2,306,697.14	-738,919.90	1,567,777.24
2.基金赎回款	-37,933,550.44	11,226,441.55	-26,707,108.89
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)	170,179,872.33	-56,989,594.62	113,190,277.71

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

泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]第1290号《关于准予泰信国策驱动灵活配置混合型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《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集632,552,556.09元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1195号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年10月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为632,964,112.52份基金份额，其中认购资金利息折合411,556.43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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含可转债、中小企业私募债券)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期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。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

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日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协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、注册登记机构、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
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
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

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	726,573.05	1,014,131.74
其中:支付销售机构的客户维护费	223,774.40	292,748.17

支付基金管理人泰信基金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:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷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	121,095.54	169,021.95

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0.25%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:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.8.2.3销售服务费

本基金本报告期内及上年度本基金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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
基金合同生效日(2015年10月27日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,001,250.00	10,001,250.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	10,001,250.00	10,001,250.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.4700%	5.8800%

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

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	11,350,889.00	7.3400%	11,350,889.00	6.8400%

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	6,724,778.56	49,986.81	43,005,203.52	69,139.99

本基金的活期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

本报告期及上年度可比期间本基金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

报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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债券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	88,305,450.00	92.51
	其中:股票	88,305,450.00	92.51
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	7,041,476.45	7.38
8	其他各项资产	111,484.24	0.12
9	合计	95,458,410.69	100.00

7.2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	5,429,700.00	5.72
B	采矿业	6,597,250.00	6.95
C	制造业	49,634,450.00	52.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,725,000.00	1.82
F	批发和零售业	1,936,550.00	2.04
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	6,189,900.00	6.52
J	金融业	16,792,600.00	17.70
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	88,305,450.00	93.07

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票。

7.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	002157	正邦科技	300,000	4,998,000.00	5.27
2	300014	亿纬锂能	100,000	3,046,000.00	3.21
3	000858	五粮液	25,000	2,948,750.00	3.11
4	603363	傲农生物	150,000	2,874,000.00	3.03
5	300498	温氏股份	76,000	2,725,360.00	2.87
6	002714	牧原股份	46,000	2,704,340.00	2.85
7	601318	中国平安	30,000	2,658,300.00	2.80
8	600030	中信证券	110,000	2,619,100.00	2.76
9	601601	中国太保	70,000	2,555,700.00	2.69
10	600036	招商银行	70,000	2,518,600.00	2.65

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	300450	先导智能	7,896,523.08	9.36
2	002537	海联金汇	7,883,645.40	9.34
3	600030	中信证券	7,665,803.40	9.08
4	300502	新易盛	7,634,702.00	9.04
5	000063	中兴通讯	5,617,066.00	6.65
6	002202	金风科技	5,397,917.00	6.40
7	002458	益生股份	5,268,706.90	6.24
8	600050	中国联通	5,152,704.00	6.10
9	300134	大富科技	5,000,118.00	5.92
10	601012	隆基股份	4,697,597.05	5.57
11	000858	五粮液	4,418,453.00	5.23
12	300498	温氏股份	4,384,491.20	5.19
13	601377	兴业证券	4,307,376.00	5.10
14	300352	北信源	4,224,447.00	5.00
15	600760	中航沈飞	4,193,678.00	4.97
16	002157	正邦科技	4,131,538.00	4.89
17	300299	富春股份	4,075,700.00	4.83
18	000977	浪潮信息	4,073,838.80	4.83
19	002405	四维图新	4,036,181.91	4.78
20	601318	中国平安	3,901,118.52	4.62
21	002709	天赐材料	3,890,136.50	4.61
22	002812	恩捷股份	3,867,243.00	4.58
23	601211	国泰君安	3,634,907.66	4.31
24	600498	烽火通信	3,519,647.10	4.17
25	002074	国轩高科	3,428,600.00	4.06
26	002508	老板电器	3,392,106.86	4.02
27	300166	东方国信	3,373,166.27	4.00
28	000625	长安汽车	3,324,374.32	3.94
29	002463	沪电股份	3,320,081.00	3.93
30	002124	天邦股份	3,281,509.00	3.89
31	002383	合众思壮	3,245,027.00	3.84
32	603363	傲农生物	3,227,580.00	3.82
33	300014	亿纬锂能	3,015,731.67	3.57
34	300188	美亚柏科	2,993,308.60	3.55
35	603218	日月股份	2,940,169.00	3.48
36	002714	牧原股份	2,917,020.00	3.46
37	600466	蓝光发展	2,804,448.00	3.32
38	300122	智飞生物	2,748,593.00	3.26
39	600340	华夏幸福	2,733,530.00	3.24
40	002768	国恩股份	2,729,332.00	3.23
41	000547	航天发展	2,684,760.00	3.18
42	002299	圣农发展	2,642,974.54	3.13
43	601601	中国太保	2,632,730.00	3.12
44	002100	天康生物	2,609,361.00	3.09
45	300377	赢时胜	2,609,082.00	3.09
46	002594	比亚迪	2,585,267.00	3.06
47	603558	健盛集团	2,540,136.00	3.01
48	002373	千方科技	2,529,298.00	3.00
49	600438	通威股份	2,473,406.00	2.93
50	603507	振江股份	2,446,028.00	2.90
51	002567	唐人神	2,415,579.00	2.86
52	002548	金新农	2,414,030.00	2.86
53	002572	索菲亚	2,386,135.00	2.83
54	600406	国电南瑞	2,376,036.00	2.81
55	600036	招商银行	2,355,100.00	2.79
56	600547	山东黄金	2,294,950.96	2.72
57	600597	光明乳业	2,285,341.00	2.71
58	601628	中国人寿	2,274,402.00	2.69
59	300316	晶盛机电	2,268,258.00	2.69
60	601899	紫金矿业	2,252,438.00	2.67
61	002301	齐心集团	2,236,234.50	2.65
62	000733	振华科技	2,221,193.00	2.63
63	600489	中金黄金	2,213,539.00	2.62
64	000401	冀东水泥	2,181,126.00	2.58
65	603601	再升科技	2,179,304.61	2.58
66	603833	欧派家居	2,168,706.26	2.57
67	002191	劲嘉股份	2,159,970.00	2.56
68	000876	新希望	2,159,218.00	2.56
69	002236	大华股份	2,116,500.00	2.51
70	600183	生益科技	2,115,457.80	2.51
71	600702	舍得酒业	2,107,000.00	2.50
72	603666	亿嘉和	2,096,845.80	2.48
73	300274	阳光电源	2,093,761.90	2.48
74	002531	天顺风能	2,072,082.00	2.45
75	000651	格力电器	2,068,891.00	2.45
76	600837	海通证券	2,049,200.00	2.43
77	600588	用友网络	2,049,099.70	2.43
78	600115	东方航空	2,045,300.00	2.42
79	002368	太极股份	2,038,914.00	2.42
80	600519	贵州茅台	2,012,930.00	2.38
81	002230	科大讯飞	2,005,571.00	2.38
82	600536	中国软件	2,001,203.82	2.37
83	300262	巴安水务	1,990,638.00	2.36
84	002648	卫星石化	1,984,855.00	2.35
85	600486	扬农化工	1,973,255.28	2.34
86	603678	火炬电子	1,972,226.00	2.34
87	300348	长亮科技	1,932,000.00	2.29
88	300170	汉得信息	1,921,500.00	2.28
89	300755	华致酒行	1,909,689.00	2.26
90	000002	万科A	1,886,242.70	2.23
91	000997	新大陆	1,875,989.98	2.22
92	002341	新纶科技	1,857,955.15	2.20
93	600801	华新水泥	1,839,900.00	2.18
94	603323	苏农银行	1,835,503.00	2.17
95	601668	中国建筑	1,791,000.00	2.12
96	300207	欣旺达	1,788,602.00	2.12
97	601800	中国交建	1,754,611.00	2.08
98	603636	南威软件	1,736,573.00	2.06
99	300357	我武生物	1,724,676.00	2.04
100	002001	新和成	1,722,116.80	2.04
101	601633	长城汽车	1,720,466.00	2.04
102	603019	中科曙光	1,704,198.00	2.02

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	600030	中信证券	8,564,476.00	10.15
2	002537	海联金汇	6,881,312.22	8.15
3	000063	中兴通讯	5,984,681.00	7.09
4	300450	先导智能	5,959,429.90	7.06
5	300502	新易盛	5,843,216.34	6.92
6	002202	金风科技	5,803,102.00	6.88
7	002458	益生股份	5,769,071.53	6.83
8	300134	大富科技	5,619,861.48	6.66
9	300299	富春股份	5,579,301.52	6.61
10	600050	中国联通	5,223,618.00	6.19
11	002531	天顺风能	5,129,469.10	6.08
12	603218	日月股份	5,069,260.21	6.01
13	002371	北方华创	4,619,774.72	5.47
14	600406	国电南瑞	4,401,586.44	5.21
15	600760	中航沈飞	4,335,580.34	5.14
16	300059	东方财富	4,226,994.47	5.01
17	002124	天邦股份	4,127,971.50	4.89
18	002709	天赐材料	4,115,581.87	4.88
19	300498	温氏股份	4,064,935.30	4.82
20	002812	恩捷股份	3,838,939.00	4.55
21	600570	恒生电子	3,544,020.91	4.20
22	000401	冀东水泥	3,469,542.00	4.11
23	002383	合众思壮	3,418,509.20	4.05
24	002074	国轩高科	3,340,016.65	3.96
25	600498	烽火通信	3,248,913.26	3.85
26	300166	东方国信	3,226,064.01	3.82
27	002508	老板电器	3,224,063.68	3.82
28	603986	兆易创新	3,221,932.00	3.82
29	300033	同花顺	3,191,736.15	3.78
30	600489	中金黄金	3,187,185.46	3.78
31	000625	长安汽车	3,183,900.91	3.77
32	000783	长江证券	3,163,100.00	3.75
33	600438	通威股份	3,159,362.30	3.74
34	000776	广发证券	3,038,899.25	3.60
35	300170	汉得信息	3,016,063.50	3.57
36	300097	智云股份	2,996,618.00	3.55
37	300188	美亚柏科	2,964,741.77	3.51
38	300274	阳光电源	2,861,634.00	3.39
39	601012	隆基股份	2,844,781.00	3.37
40	000876	新希望	2,800,296.55	3.32
41	002373	千方科技	2,770,462.00	3.28
42	601155	新城控股	2,719,487.11	3.22
43	000547	航天发展	2,684,924.00	3.18
44	300316	晶盛机电	2,624,054.00	3.11
45	002838	道恩股份	2,607,161.52	3.09
46	002405	四维图新	2,601,069.74	3.08
47	002299	圣农发展	2,483,422.00	2.94
48	603558	健盛集团	2,480,972.82	2.94
49	300122	智飞生物	2,471,340.30	2.93
50	600748	上实发展	2,466,590.38	2.92
51	600466	蓝光发展	2,464,080.26	2.92
52	603507	振江股份	2,457,185.02	2.91
53	603636	南威软件	2,441,656.50	2.89
54	300262	巴安水务	2,433,907.63	2.88
55	000600	建投能源	2,428,408.16	2.88
56	600340	华夏幸福	2,383,705.51	2.82
57	002594	比亚迪	2,285,697.98	2.71
58	002572	索菲亚	2,272,898.00	2.69
59	000733	振华科技	2,266,975.00	2.69
60	600837	海通证券	2,198,177.80	2.60
61	603833	欧派家居	2,189,968.18	2.59
62	000543	皖能电力	2,185,402.54	2.59
63	002368	太极股份	2,167,242.16	2.57
64	600872	中炬高新	2,166,500.00	2.57
65	000977	浪潮信息	2,159,103.86	2.56
66	002100	天康生物	2,135,740.95	2.53
67	603323	苏农银行	2,117,311.00	2.51
68	000858	五粮液	2,102,844.00	2.49
69	300377	赢时胜	2,069,409.78	2.45
70	600702	舍得酒业	2,059,479.80	2.44
71	002157	正邦科技	2,050,026.95	2.43
72	603678	火炬电子	2,048,307.73	2.43
73	600588	用友网络	2,025,348.55	2.40
74	300253	卫宁健康	2,009,249.68	2.38
75	002341	新纶科技	2,007,502.00	2.38
76	600183	生益科技	1,994,405.92	2.36
77	601377	兴业证券	1,993,192.72	2.36
78	002230	科大讯飞	1,986,274.57	2.35
79	603019	中科曙光	1,932,280.00	2.29
80	300168	万达信息	1,925,336.52	2.28
81	603666	亿嘉和	1,920,440.68	2.28
82	300036	超图软件	1,901,279.79	2.25
83	600115	东方航空	1,901,157.00	2.25
84	600486	扬农化工	1,845,106.38	2.19
85	300474	景嘉微	1,842,673.09	2.18
86	000651	格力电器	1,824,826.00	2.16
87	601211	国泰君安	1,790,374.00	2.12
88	002567	唐人神	1,743,920.76	2.07
89	300357	我武生物	1,734,538.11	2.05
90	300014	亿纬锂能	1,733,020.35	2.05
91	000997	新大陆	1,730,950.00	2.05
92	300590	移为通信	1,729,732.76	2.05
93	600801	华新水泥	1,722,664.58	2.04
94	300073	当升科技	1,694,186.85	2.01

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	341,125,198.27
卖出股票收入(成交)总额	330,898,742.70

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

本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

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

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

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

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

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

本基金本期末投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2基金投资的前十名股票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	92,684.69
2	应收证券清算款	7,388.95
3	应收股利	-
4	应收利息	1,459.48
5	应收申购款	9,951.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,484.24

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
2,600	59,494.68	43,659,767.45	28.22%	111,026,410.40	71.78%

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	19,880.72	0.0129%

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的情况

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

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(2015年10月27日)基金份额总额	632,964,112.52
本报告期期初基金份额总额	165,867,585.68
本报告期期间基金总申购份额	7,247,506.62
减:本报告期期间基金总赎回份额	18,428,914.45
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	154,686,177.85

§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

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	
国信证券	2	223,668,554.62	33.30%	204,205.45	34.30%	-
天风证券	1	108,658,380.69	16.18%	79,461.43	13.35%	-
广州证券	1	91,701,427.06	13.65%	83,567.53	14.04%	-
中银国际	1	64,681,107.20	9.63%	58,944.43	9.90%	-
东兴证券	1	63,812,295.81	9.50%	59,428.05	9.98%	-
中泰证券	1	53,392,898.61	7.95%	49,725.09	8.35%	-
浙商证券	1	30,298,072.03	4.51%	27,610.47	4.64%	-
华创证券	2	20,836,109.19	3.10%	18,988.12	3.19%	-
渤海证券	1	14,668,321.76	2.18%	13,367.21	2.25%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	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、本报告期交易单元无变动。

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

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。

泰信基金管理有限公司
2019年8月24日