# 泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资 基金 2019 年半年度报告

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 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

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

基金托管人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。

# 1.2 目录

<b>§1</b>	重要	提示及目录	2
	1.1	重要提示	2
	1.2	目录	3
<b>§2</b>	基金	简介	6
	2.1	基金基本情况	6
	2.2	基金产品说明	6
	2.3	基金管理人和基金托管人	6
	2.4	信息披露方式	7
	2.5	其他相关资料	7
<b>§3</b>	主要	财务指标和基金净值表现	8
	3.1	主要会计数据和财务指标	8
	3.2	基金净值表现	8
<b>§4</b>	管理	人报告	10
	4.1	基金管理人及基金经理情况	10
	4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
	4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
	4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
	4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
	4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
	4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
	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	14
<b>§</b> 5	托管	人报告	15
	5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
	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	15
	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	15
<b>§</b> 6	半年	度财务会计报告(未经审计)	16
	6.1	资产负债表	16
	6.2	利润表	17
	6.3	所有者权益(基金净值)变动表	18

	6.4 报表附注	19
§7	投资组合报告	37
	7.1 期末基金资产组合情况	37
	7.2 期末按行业分类的股票投资组合	37
	7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
	7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
	7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
	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	45
	7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	45
	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	45
	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	45
	7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
	7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
	7.12 投资组合报告附注	46
<b>§8</b>	基金份额持有人信息	47
	8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
	8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
	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	47
<b>§9</b>	开放式基金份额变动	48
<b>§1</b> 0	) 重大事件揭示	49
	10.1 基金份额持有人大会决议	49
	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	49
	10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
	10.4 基金投资策略的改变	49
	10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
	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	49
	10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
	10.8 其他重大事件	51
§11	影响投资者决策的其他重要信息	54
	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	54

	11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12	2 备查文件目录	
	12.1 备查文件目录	
	12.2 存放地点	55
	12.3 查阅方式	55

# § 2 基金简介

# 2.1 基金基本情况

基金名称	泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金
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

	<u> </u>
	本基金将积极投资于受益于国家政策驱动、符合经济
投资目标	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。
	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。
投资策略	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。
JL V+ LL + \( \tau \) + \( \tau \)	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率
业绩比较基准	×50%
	本基金为混合型基金,属于中高风险、中高收益的基
风险收益特征	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。
L	1

# 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	
	姓名	胡囡	郭明	
信息披露负责人	联系电话	021-20899098	(010) 66105799	
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn	
客户服务电话		400-888-5988	95588	

传真	021-20899008	(010) 66105798	
注册地址	中国(上海)自由贸易试验 区浦东南路 256 号 37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
办公地址	中国(上海)自由贸易试验 区浦东南路 256 号 华夏银 行大厦 36-37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
邮政编码	200120	100140	
法定代表人	万众	陈四清	

# 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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

# 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 号华夏银行大厦 36、37 层

# §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
本期加权平均净值利润率	17. 57%
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)
期末可供分配利润	-59, 802, 885. 46
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-38.70%

- 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
------------	-----------	-----------

地与	TIII A	任本基金的基金组	<b>全理(助理)期限</b>	证券从	7H 0U
姓名	职务	任职日期	离任日期	业年限	说明 
车广路 先生	本基金 经理 蒸 等精选 基金 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,受中央政治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改革政策。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56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

- 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

			平位: 八氏巾儿
资 产	   附注号	本期末	上年度末
贝 /	M3在 G	2019年6月30日	2018年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	=	=
买入返售金融资产	6.4.7.4	=	=
应收证券清算款		7, 388. 95	=
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	=
资产总计		95, 458, 410. 69	85, 153, 279. 18
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	_
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	6.4.7.7	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			I
其他负债	6.4.7.8	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	6.4.7.9	154, 686, 177. 85	165, 867, 585. 68
未分配利润	6.4.7.10	-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

		本期	上年度可比期间
项 目	附注号	2019年1月1日至	2018年1月1日至
		2019年6月30日	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	6.4.7.11	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		-	1
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	6.4.7.12	11, 029, 997. 82	-5, 702, 655. 48
基金投资收益		_	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	1
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	1
贵金属投资收益	6.4.7.14	_	_
衍生工具收益	6.4.7.15	=	=
股利收益	6.4.7.16	547, 673. 97	312, 556. 81
3.公允价值变动收益(损失以"-"	6.4.7.17	7, 509, 559. 41	-7, 316, 745. 49
号填列)		7, 505, 555, 41	7, 310, 743, 43
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		=	=
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	23, 595. 28	2,697.90
减:二、费用		1, 928, 962. 45	2, 644, 711.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	726, 573. 05	1, 014, 131. 74
2. 托管费	6.4.10.2.2	121, 095. 54	169, 021. 95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	_	_

4. 交易费用	6.4.7.19	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	6.4.7.20	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

	2019 年	本期 1月1日至 2019年6月:	30 日
项目	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	2018年	上年度可比期间 1月1日至2018年6月3	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:

#### 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《企业会计准则一基本准则》、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[2016]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 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	6, 724, 778. 56
定期存款	_
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	-
合计:	6, 724, 778. 56

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

	-T: E		本期末	
	项目		2019年6月30日	
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		83, 043, 816. 05	88, 305, 450. 00	5, 261, 633. 95
贵金属	投资-金交所			
黄金合金	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		83, 043, 816. 05	88, 305, 450. 00	5, 261, 633. 95

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

# 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

# 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末
, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	2019年6月30日
应收活期存款利息	1, 293. 70
应收定期存款利息	_
应收其他存款利息	_
应收结算备付金利息	128. 25
应收债券利息	_
应收资产支持证券利息	_
应收买入返售证券利息	_
应收申购款利息	_
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	37. 53
合计	1, 459. 48

# 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位: 人民币元

福日	本期末
项目	2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	273, 264. 65
银行间市场应付交易费用	_
合计	273, 264. 65

# 6.4.7.8 其他负债

单位: 人民币元

本期末 本期末   本期末   本期末   ・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・
---

	2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24. 11
预提费用	86, 174. 37
合计	86, 198. 48

# 6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

	本期	
项目	2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	165, 867, 585. 68	165, 867, 585. 68
本期申购	7, 247, 506. 62	7, 247, 506. 62
本期赎回(以"-"号填列)	-18, 428, 914. 45	-18, 428, 914. 45
- 基金拆分/份额折算前	_	_
基金拆分/份额折算变动份额	_	_
本期申购	_	_
本期赎回(以"-"号填列)	-	_
本期末	154, 686, 177. 85	154, 686, 177. 85

申购含转换入份额; 赎回含转换出份额。

# 6.4.7.10 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	-72, 064, 986. 73	-9, 394, 222. 35	-81, 459, 209. 08
本期利润	9, 727, 464. 37	7, 509, 559. 41	17, 237, 023. 78
本期基金份额交易 产生的变动数	4, 472, 024. 15	-52, 724. 31	4, 419, 299. 84
其中:基金申购款	-2, 849, 119. 08	414, 934. 20	-2, 434, 184. 88
基金赎回款	7, 321, 143. 23	-467, 658. 51	6, 853, 484. 72
本期已分配利润	_		_
本期末	-57, 865, 498. 21	-1, 937, 387. 25	-59, 802, 885. 46

# 6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	49, 986. 81

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	4, 345. 40
其他	827.54
合计	55, 159. 75

# 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	330, 898, 742. 70
减: 卖出股票成本总额	319, 868, 744. 88
买卖股票差价收入	11, 029, 997. 82

## 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期未持有债券。

## 6.4.7.13.1 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。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未投资贵金属。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

## 6.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
<b>ツ</b> 日	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	547, 673. 97
基金投资产生的股利收益	-
合计	547, 673. 97

# 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	7, 509, 559. 41
——股票投资	7, 509, 559. 41
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	7, 509, 559. 41

# 6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	23, 367. 49
转出基金补偿费	227. 79
合计	23, 595. 28

- 1. 本基金的赎回费率按持有期间递减,不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
- 2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成,其中不低于转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

# 6.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	985, 786. 49
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	_
其中: 申购费	-
赎回费	-

合计	985, 786. 49
台计	985, 786. 49

## 6.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期
2117	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29, 752. 78
信息披露费	56, 421. 59
账户服务费	9,000.00
银行划款手续费	333.00
账户维护费	-
合计	95, 507. 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,本基金并无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本报告期末,本基金并无须做披露的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、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	基金托管人、基金销售机构
银行")	至並11百八、至並明日初11g
山东省国际信托股份有限公司("山东国	   基金管理人的股东
托")	<b>至並自垤八印放</b> 小
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。

## 6.4.10 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未有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未有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未有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未有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未有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 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。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
火口	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付	191 005 54	160 091 05
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 第 28 页 共 55 页 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。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度本基金未发生销售服务费用。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

## 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.4.1 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
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%

## 6.4.10.4.2 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

	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018年12月31日	
关联方名称	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%

## 6.4.10.5 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

<del>-</del>	-	本期	上年度可比期间		
关联方   名称	2019年1月1日	至 2019 年 6 月 30 日	2018年1月1日至2018年6月30日		
<b>石</b> 你	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。

## 6.4.10.6 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。

## 6.4.10.7 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。

## 6.4.11 利润分配情况

报告期末本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末 ( 2019 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。

## 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

## 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关

的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现"风险和收益相匹配"的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了以审计、合规与风险控制委员会、督察长为核心,对公司所有经营管理行为进行监督的四道监控防线。

监察稽核部对公司经营、基金投资等业务运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督,如有必要则由督察长向公司董事长和中国证监会报告。目前,公司的事前、事中、事后三个控制层次的风险管理体系相对清晰。各业务部门负责事前风险防范;风险管理部负责对公司运营过程中产生或潜在的风险进行事中管理和监控,并负责运用定量分析模型,根据各基金的投资目标及投资策略,定期对基金的投资组合风险进行评估,向投资决策委员会提交业绩评估报告;监察稽核部负责对公司各项业务进行定期、不定期检查,负责事后监督。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去 估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险 损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特 征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时 可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

## 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款 存放在本基金的托管人中国工商银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所 进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险 可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限 制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严 密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理 人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购 赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 6 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不 计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合 约到期现金流量。

## 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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2019 年 6 月 30 日,本基金未持有流动性受限资产。

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第 32 页 共 55 页

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 2019 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 95,030,228.56 元,超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

## 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

2	本期末 019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	6, 724, 778. 56	-	_	_	6, 724, 778. 56

## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ##						
交易性金融资产	结算备付金	316, 697. 89	_	=	-	316, 697. 89
应收证券清算款	存出保证金	92, 684. 69	_		=	92, 684. 69
应收利息	交易性金融资产	_	_	_	88, 305, 450. 00	088, 305, 450. 00
应收申购款	应收证券清算款	=	_	_	7, 388. 9	7, 388. 95
其他资产	应收利息	=	_	_	1, 459. 48	1, 459. 48
資产总计     7, 134, 161. 14     -     -     88, 324, 249. 5595, 458, 410. 69       免债     -     -     46, 738. 53     46, 738. 53     应付38. 53     应付38. 53     应付16, 126. 77     117     19, 354. 47	应收申购款	=	_	_	9, 951. 12	9, 951. 12
○ 受付 で 対	其他资产	_	_	_	-	_
○ 受付 で 対	资产总计	7, 134, 161. 14			88, 324, 249. 5	595, 458, 410. 69
应付赎回款						
应付管理人报酬	应付证券清算款	_	_	_	46, 738. 53	3 46, 738. 53
应付托管费 — — — — — — — — — — — — — — — — — — —	应付赎回款	_	_	_	33, 435. 40	33, 435. 40
应付交易费用     -     -     273, 264. 65     275, 118. 30     594, 883, 292. 39     39     440     6     440, 014. 62     440, 014. 62     440, 014. 62     440, 014. 62     440, 014. 62     475, 575, 571, 494. 03     475, 575, 575, 575, 575, 575, 575, 575,	应付管理人报酬	_	_	_	116, 126. 7	7 116, 126. 77
其他负债	应付托管费	_	=	=	19, 354. 4	7 19, 354. 47
负债总计     -     -     575, 118.30     575, 118.30       利率敏感度缺口     7, 134, 161.14     -     87, 749, 131.2594, 883, 292.39       上年度末     2018年12月31     1年以内     1-5年     5年以上     合计       银行存款     25, 071, 494.03     -     -     25, 071, 494.03     -     -     25, 071, 494.03     -     440, 104.62     -     440, 104.62     -     -     440, 104.62     -     -     97, 232.21     -     -     97, 232.21     -     -     -     97, 232.21     -     -     -     59, 539, 437. 2059, 539, 437. 20     59, 539, 437. 20     59, 539, 437. 20     59, 539, 437. 20     59, 539, 437. 20     59, 59, 539, 437. 20     59, 59, 539, 437. 20     59, 59, 539, 437. 20     59, 59, 539, 437. 20     59, 59, 59, 539, 437. 20     59, 59, 539, 437. 20     59, 59, 539, 437. 20     59, 59, 539, 437. 20     59, 59, 539, 437. 20     59, 59, 59, 59, 59, 59, 59, 59, 59, 59,	应付交易费用	_	=	=	273, 264. 6	5 273, 264. 65
利率敏感度缺口 7, 134, 161. 14 ——87, 749, 131. 2594, 883, 292. 39 上年度末 2018 年 12 月 31 日年以内 1-5 年 5 年以上 不计息 合计 日 资产 银行存款 25, 071, 494. 03 ——25, 071, 494. 03 结算备付金 440, 104. 62 ——440, 104. 62 存出保证金 97, 232. 21 ——97, 232. 21 交易性金融资产 ——59, 539, 437. 20 59, 539, 437. 20 应收利息 ——4, 891. 28 4, 891. 28 应收申购款 ——119. 84 119. 84 资产总计 25, 608, 830. 86 ——59, 544, 448. 3285, 153, 279. 18 负债 应付赎回款 ——4, 017. 96 4, 017. 96 应付管理人报酬 ——111, 183. 50 111, 183. 50 应付托管费 ——18, 530. 56 18, 530. 56 应付交易费用 ——271, 159. 28 271, 159. 28 其他负债 ——340, 011. 28 340, 011. 28 负债总计 ——744, 902. 58 744, 902. 58	其他负债	_	_	_	86, 198. 48	86, 198. 48
上年度末     2018 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     25,071,494.03     -     -     -25,071,494.03       结算备付金     440,104.62     -     -     440,104.62       存出保证金     97,232.21     -     -     97,232.21       交易性金融资产     -     -     -     4,891.28     4,891.28       应收利息     -     -     -     4,891.28     4,891.28       应收申购款     - <td>负债总计</td> <td>_</td> <td>-</td> <td>_</td> <td>575, 118. 30</td> <td>575, 118. 30</td>	负债总计	_	-	_	575, 118. 30	575, 118. 30
2018 年 12 月 31 日 年以内 日 5 年以上 不计息 合计 日 资产	利率敏感度缺口	7, 134, 161. 14	_	_	87, 749, 131. 2	594, 883, 292. 39
日 资产 银行存款 25,071,494.0325,071,494.03 结算备付金 440,104.62 440,104.62 存出保证金 97,232.21 97,232.21 交易性金融资产59,539,437.2059,539,437.20 应收利息 4,891.28 4,891.28 应收申购款 119.84 119.84 资产总计 25,608,830.8659,544,448.3285,153,279.18 负债 应付赎回款 4,017.96 4,017.96 应付管理人报酬 111,183.50 111,183.50 应付托管费 18,530.56 18,530.56 应付交易费用 271,159.28 271,159.28 其他负债 340,011.28 340,011.28 负债总计 - 744,902.58 744,902.58	1 4					
银行存款 25,071,494.03 25,071,494.03	上年度末					
银行存款 25,071,494.03 25,071,494.03		1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
结算备付金     440, 104. 62     -     -     440, 104. 62       存出保证金     97, 232. 21     -     -     97, 232. 21       交易性金融资产     -     -     59, 539, 437. 2059, 539, 437. 20       应收利息     -     -     4, 891. 28     4, 891. 28       应收申购款     -     -     119. 84     119. 84       资产总计     25, 608, 830. 86     -     -     59, 544, 448. 3285, 153, 279. 18       负债     -     -     4, 017. 96     4, 017. 96       应付赎回款     -     -     -     111, 183. 50     111, 183. 50       应付管理人报酬     -     -     18, 530. 56     18, 530. 56       应付交易费用     -     -     271, 159. 28     271, 159. 28       其他负债     -     -     340, 011. 28     340, 011. 28       负债总计     -     -     744, 902. 58     744, 902. 58		1 年以内	1-5 年	5年以上	不计息	合计
存出保证金     97, 232. 21     -     -     97, 232. 21       交易性金融资产     -     -     59, 539, 437. 2059, 539, 437. 20       应收利息     -     -     4, 891. 28     4, 891. 28       应收申购款     -     -     119. 84     119. 84       资产总计     25, 608, 830. 86     -     -     59, 544, 448. 3285, 153, 279. 18       负债     -     -     4, 017. 96     4, 017. 96       应付赎回款     -     -     -     111, 183. 50     111, 183. 50       应付管理人报酬     -     -     18, 530. 56     18, 530. 56       应付交易费用     -     -     271, 159. 28     271, 159. 28       其他负债     -     -     340, 011. 28     340, 011. 28       负债总计     -     -     744, 902. 58     744, 902. 58	2018年12月31日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
交易性金融资产     -     -59,539,437.2059,539,437.20       应收利息     -     -4,891.28     4,891.28       应收申购款     -     -119.84     119.84       资产总计     25,608,830.86     -     -59,544,448.3285,153,279.18       负债     -     -4,017.96     4,017.96       应付赎回款     -     -     -111,183.50     111,183.50       应付管理人报酬     -     -     -18,530.56     18,530.56       应付交易费用     -     -     271,159.28     271,159.28       其他负债     -     -     340,011.28     340,011.28       负债总计     -     -     744,902.58     744,902.58	2018年12月31日			5 年以上	不计息	
应收利息     -     -     4,891.28     4,891.28       应收申购款     -     -     119.84     119.84       资产总计     25,608,830.86     -     -     59,544,448.3285,153,279.18       负债     -     -     4,017.96     4,017.96       应付赎回款     -     -     111,183.50     111,183.50       应付管理人报酬     -     -     18,530.56     18,530.56       应付交易费用     -     -     271,159.28     271,159.28       其他负债     -     -     340,011.28     340,011.28       负债总计     -     744,902.58     744,902.58	2018年12月31日 安产银行存款	25, 071, 494. 03	_	5 年以上 - -	不计息	-25, 071, 494. 03
应收申购款     -     -     -     119.84     119.84       资产总计     25,608,830.86     -     -     59,544,448.3285,153,279.18       负债     -     -     4,017.96     4,017.96       应付赎回款     -     -     111,183.50     111,183.50       应付管理人报酬     -     -     18,530.56     18,530.56       应付交易费用     -     -     271,159.28     271,159.28       其他负债     -     -     340,011.28     340,011.28       负债总计     -     744,902.58     744,902.58	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金	25, 071, 494. 03 440, 104. 62	_	5 年以上 - - -	不计息	-25, 071, 494. 03 - 440, 104. 62
资产总计     25,608,830.86     -     -59,544,448.3285,153,279.18       负债     -     -4,017.96     4,017.96       应付赎回款     -     -     111,183.50     111,183.50       应付管理人报酬     -     -     18,530.56     18,530.56       应付交易费用     -     -     271,159.28     271,159.28       其他负债     -     -     340,011.28     340,011.28       负债总计     -     744,902.58     744,902.58	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金	25, 071, 494. 03 440, 104. 62	_	5 年以上 - - - -	-	-25, 071, 494. 03 - 440, 104. 62 - 97, 232. 21
负债     一     4,017.96     4,017.96       应付赎回款     -     -     4,017.96     4,017.96       应付管理人报酬     -     -     111,183.50     111,183.50       应付托管费     -     -     18,530.56     18,530.56       应付交易费用     -     -     271,159.28     271,159.28       其他负债     -     -     340,011.28     340,011.28       负债总计     -     744,902.58     744,902.58	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金 交易性金融资产	25, 071, 494. 03 440, 104. 62	_	5 年以上 - - - -	59, 539, 437. 20	-25, 071, 494. 03 - 440, 104. 62 - 97, 232. 21 059, 539, 437. 20
应付赎回款     -     -     4,017.96     4,017.96       应付管理人报酬     -     -     111,183.50     111,183.50       应付托管费     -     -     18,530.56     18,530.56       应付交易费用     -     -     271,159.28     271,159.28       其他负债     -     -     340,011.28     340,011.28       负债总计     -     744,902.58     744,902.58	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金 交易性金融资产 应收利息	25, 071, 494. 03 440, 104. 62	_	5 年以上 - - - - -	59, 539, 437. 20 4, 891. 28	-25, 071, 494. 03 - 440, 104. 62 - 97, 232. 21 059, 539, 437. 20 4, 891. 28
应付管理人报酬     -     -     111, 183. 50     111, 183. 50       应付托管费     -     -     18, 530. 56     18, 530. 56       应付交易费用     -     -     271, 159. 28     271, 159. 28       其他负债     -     -     340, 011. 28     340, 011. 28       负债总计     -     744, 902. 58     744, 902. 58	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金 交易性金融资产 应收利息 应收申购款	25, 071, 494, 03 440, 104, 62 97, 232, 21		5 年以上 - - - - -	59, 539, 437. 20 4, 891. 23 119. 8	-25, 071, 494. 03 - 440, 104. 62 - 97, 232. 21 059, 539, 437. 20 8 4, 891. 28 4 119. 84
应付托管费   -   -   18,530.56   18,530.56     应付交易费用   -   -   271,159.28   271,159.28     其他负债   -   -   340,011.28   340,011.28     负债总计   -   -   744,902.58   744,902.58	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金 交易性金融资产 应收利息 应收申购款 资产总计	25, 071, 494, 03 440, 104, 62 97, 232, 21		5 年以上 - - - - -	59, 539, 437. 20 4, 891. 23 119. 8	-25, 071, 494. 03 - 440, 104. 62 - 97, 232. 21 059, 539, 437. 20 8 4, 891. 28 4 119. 84
应付交易费用     -     -     271, 159. 28     271, 159. 28     271, 159. 28       其他负债     -     -     340, 011. 28     340, 011. 28       负债总计     -     -     744, 902. 58     744, 902. 58	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金 交易性金融资产 应收利息 应收申购款 资产总计 负债	25, 071, 494, 03 440, 104, 62 97, 232, 21		5 年以上 - - - - -	59, 539, 437. 20 4, 891. 23 119. 8- 59, 544, 448. 33	-25, 071, 494. 03 -440, 104. 62 -97, 232. 21 059, 539, 437. 20 8 4, 891. 28 4 119. 84 285, 153, 279. 18
其他负债     -     -     340,011.28     340,011.28       负债总计     -     -     744,902.58     744,902.58	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金 交易性金融资产 应收利息 应收申购款 资产总计 负债 应付赎回款	25, 071, 494, 03 440, 104, 62 97, 232, 21		5 年以上 - - - - - -	59, 539, 437. 20 4, 891. 23 119. 8 59, 544, 448. 33 4, 017. 90	-25, 071, 494. 03 -440, 104. 62 -97, 232. 21 059, 539, 437. 20 8 4, 891. 28 4 119. 84 285, 153, 279. 18 6 4, 017. 96
负债总计 744,902.58 744,902.58	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金 交易性金融资产 应收利息 应收申购款 资产总计 负债 应付赎回款	25, 071, 494, 03 440, 104, 62 97, 232, 21		5 年以上 - - - - - - -	59, 539, 437. 20 4, 891. 23 119. 8- 59, 544, 448. 33 4, 017. 90 111, 183. 50	-25, 071, 494. 03 -440, 104. 62 -97, 232. 21 059, 539, 437. 20 8 4, 891. 28 4 119. 84 285, 153, 279. 18 6 4, 017. 96 0 111, 183. 50
	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金 交易性金融资产 应收利息 应收申购款 资产总计 负债 应付赎回款 应付管理人报酬	25, 071, 494, 03 440, 104, 62 97, 232, 21		5 年以上 - - - - - - -	59, 539, 437. 20 4, 891. 23 119. 8 59, 544, 448. 33 4, 017. 90 111, 183. 50 18, 530. 50	-25, 071, 494. 03 -440, 104. 62 -97, 232. 21 059, 539, 437. 20 8 4, 891. 28 4 119. 84 285, 153, 279. 18 6 4, 017. 96 0 111, 183. 50 18, 530. 56
利率敏感度缺口 25,608,830.86 - 58,799,545.7484,408,376.60	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金 交易性金融资产 应收利息 应收申购款 资产总计 负债 应付赎回款 应付管理人报酬 应付托管费	25, 071, 494, 03 440, 104, 62 97, 232, 21		5 年以上	59, 539, 437. 20 4, 891. 23 119. 8- 59, 544, 448. 33 4, 017. 90 111, 183. 50 18, 530. 50 271, 159. 23	-25, 071, 494. 03 -440, 104. 62 97, 232. 21 059, 539, 437. 20 8 4, 891. 28 4 119. 84 285, 153, 279. 18 6 4, 017. 96 111, 183. 50 6 18, 530. 56 8 271, 159. 28
	2018 年 12 月 31 日 资产 银行存款 结算备付金 存出保证金 交易性金融资产 应收申购款 资产总计 负债 应付赎回款 应付管理人报酬 应付充易费用 其他负债	25, 071, 494, 03 440, 104, 62 97, 232, 21		5 年以上 - - - - - - - - -	59, 539, 437. 20 4, 891. 23 119. 8- 59, 544, 448. 33 4, 017. 90 111, 183. 50 18, 530. 50 271, 159. 23 340, 011. 23 744, 902. 53	25, 071, 494. 03 440, 104. 62 97, 232. 21 059, 539, 437. 20 8 4, 891. 28 4 119. 84 285, 153, 279. 18 6 4, 017. 96 0 111, 183. 50 18, 530. 56 8 271, 159. 28 340, 011. 28 744, 902. 58

# 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日,本基金未持有交易性债券投资(2018 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(2018 年 12 月 31 日:同)。

### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基 金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用"自上而下"的策略,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合资产配置比例: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。此外,本基金的基金管理人每日对本基 金 所 持 有 的 证 券 价 格实 施监 控 ,定 期 运 用 多种 定 量 方 法 对 基 金 进 行风 险 度 量 ,包 括 VaR(ValueatRisk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
项目	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	88, 305, 450. 00	93. 07	-	_
交易性金融资产-基金投资	_	_	_	_
交易性金融资产一债券投资	_	_	_	_

交易性金融资产一贵金属投				
资	_		_	_
衍生金融资产一权证投资	_	_	_	_
其他	_	_	_	_
合计	88, 305, 450. 00	93. 07	_	_

# 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变				
	对资产负债表日基金资产净值的				
	   相关风险变量的变动	影响金额(单	位:人民币元)		
   分析	相大/NMX 文里的文约	本期末 ( 2019年6月	上年度末( 2018 年 12 月		
25/471		30 日 )	31 日 )		
	1. 除业绩比较基准上升 5%	5, 153, 924. 60	7, 424, 624. 23		
	2. 除业绩比较基准下降 5%	-5, 153, 924. 60	-7, 424, 624. 23		

## 6.4.14 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

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
В	采矿业	6, 597, 250. 00	6.95
С	制造业	49, 634, 450. 00	52. 31
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	-	-
Е	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	=	_
Н	住宿和餐饮业	=	_
Ι	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	-	-
0	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所有股票投资明细

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
11	600597	光明乳业	230, 000	2, 472, 500. 00	2.61
12	300352	北信源	390, 000	2, 406, 300. 00	2. 54
13	603601	再升科技	300, 000	2, 388, 000. 00	2. 52
14	002301	齐心集团	200, 000	2, 318, 000. 00	2.44
15	002463	沪电股份	170, 000	2, 315, 400. 00	2.44
16	601628	中国人寿	80,000	2, 265, 600. 00	2. 39
17	600547	山东黄金	55,000	2, 264, 350. 00	2. 39
18	600489	中金黄金	220,000	2, 259, 400. 00	2. 38
19	002236	大华股份	150,000	2, 178, 000. 00	2. 30
20	002405	四维图新	135, 000	2, 173, 500. 00	2. 29
21	600519	贵州茅台	2, 200	2, 164, 800. 00	2. 28
22	601377	兴业证券	320,000	2, 156, 800. 00	2. 27
23	002548	金新农	170, 000	2, 108, 000. 00	2. 22
24	601012	隆基股份	90, 000	2, 079, 900. 00	2. 19
25	601899	紫金矿业	550,000	2, 073, 500. 00	2. 19

26	002768	国恩股份	80,000	2, 020, 000. 00	2. 13
27	601211	国泰君安	110,000	2, 018, 500. 00	2. 13
28	300502	新易盛	80,000	1,961,600.00	2.07
29	300755	华致酒行	55, 000	1, 936, 550. 00	2.04
30	002648	卫星石化	130,000	1, 934, 400. 00	2.04
31	002191	劲嘉股份	150, 000	1,861,500.00	1.96
32	300207	欣旺达	150, 000	1, 728, 000. 00	1.82
33	601668	中国建筑	300,000	1, 725, 000. 00	1.82
34	300134	大富科技	110,000	1, 708, 300. 00	1.80
35	300450	先导智能	50, 000	1,680,000.00	1.77
36	000977	浪潮信息	70,000	1,670,200.00	1.76
37	600585	海螺水泥	40,000	1,660,000.00	1.75
38	600536	中国软件	30,000	1,610,100.00	1.70
39	600809	山西汾酒	22, 000	1, 519, 100. 00	1.60

# 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

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

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	<b>6.</b> 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

	T	1		
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** 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

			持有人结构				
持有人户数	户均持有的	机构投资者	<b>沙</b> 资者 个		人投资者		
(户)	基金份额	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

		股票交易		应支付该券商的佣金		
券商名称	交易单元 数量	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	备注
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	_	1	_	-	_
新时代证券	2	_	1	_	-	-
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	_	ı	_	_	_
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

	债券交易		债券回购交易		权证交易	
券商名称	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	_	-	-	_	ı	_

广州证券	=	=	=	=	=	-
中银国际	-	-	-	_	П	_
东兴证券	i	-	-	_	ı	-
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	-	-	_	_	-	_

# 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	18年4季度报告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019年1月21日
2	暂停旗下基金在大泰金石相关销 售业务	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019年1月30日
3	新增上海中正达广基金销售有限 公司为销售机构 并开通转换、定投及费率优惠业 务的公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019年3月20日
4	提示投资者更新身份信息公告	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019年3月22日
5	参加国信证券费率优惠业务	《证券时报》及公司 网站 (www.ftfund.com)	2019年3月26日

		《证券时报》及公司	
	温畅机次之工户汇件类型站八生		9010年9月97日
6	调整投资者开户证件类型的公告	网站 (www.ftfund.com)	2019年3月27日
		《证券时报》及公司	0010 年 0 日 00 日
7	18 年年度报告	网站	2019年3月28日
		(www.ftfund.com)	
		《证券时报》及公司	
8	提示投资者更新身份信息公告	网站	2019年3月28日
		(www.ftfund.com)	
9	中国中投证券开通定投业务、参加费率优惠	《证券时报》及公司	2010 7 2 7 20 7
		网站	2019年3月29日
		(www.ftfund.com)	
		《证券时报》及公司	
10	工行费率优惠	网站	2019年3月30日
		(www.ftfund.com)	
11	在爱建证券开通定投业务并参加	《证券时报》及公司	
	费率优惠活动的公告	网站	2019年4月4日
		(www.ftfund.com)	
	提示投资者更新身份信息公告	《证券时报》及公司	
12		网站	2019年4月4日
		(www.ftfund.com)	
		《证券时报》及公司	
13	提示投资者更新身份信息公告	网站	2019年4月16日
		(www.ftfund.com)	
		《证券时报》及公司	
14	19 年 1 季度报告	网站	2019年4月18日
		(www.ftfund.com)	
		《证券时报》及公司	
15	提示投资者更新身份信息公告	网站	2019年5月14日
		(www.ftfund.com)	
	   参加北京恒天明泽基金销售有限	《证券时报》及公司	
16	公司申购费率优惠业务	网站	2019年5月17日
		(www.ftfund.com)	
	   新增阳光人寿保险为销售机构并	《证券时报》及公司	
17	开通转换定投费率优惠业务	网站	2019年6月11日
		(www.ftfund.com)	
		《证券时报》及公司	
18	可投资科创板股票公告	网站	2019年6月22日
		(www.ftfund.com)	
		《证券时报》及公司	
19	停牌股票估值调整(中科曙光)	网站	2019年6月26日
		(www.ftfund.com)	
20	   参加中国银行定投费率优惠	《证券时报》及公司	2019年6月27日
	ンペローははんなステル心	网站	

	(www.ftfund.com)	

# § 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国策驱动灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信国策驱动灵活配置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、 基金托管人业务资格批件和营业执照

#### 12.2 存放地点

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

#### 12.3 查阅方式

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

泰信基金管理有限公司 2019年8月24日