

# 泰信行业精选灵活配置混合型证券投资 基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
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>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	泰信行业精选混合	
基金主代码	290012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 3 月 4 日	
基金管理人	泰信基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	245,281,755.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰信行业精选混合 A	泰信行业精选混合 C
下属分级基金的交易代码	290012	002583
报告期末下属分级基金的份额总额	185,716,445.31 份	59,565,310.57 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	把握行业发展趋势和市场运行趋势，在经济发展以及市场运行的不同阶段所蕴含的行业投资机会，在控制风险的前提下，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	紧密跟踪中国经济动向，把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征，挖掘不同发展阶段下的行业投资机会，综合运用主题投资、行业轮动等投资策略，追求基金资产的长期、持续增值。本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个券精选策略，同时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的波动风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品。

### 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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘小舫
	联系电话	姜敏
	电子邮箱	021-20899003
客户服务电话	xxpl@ftfund.com	4006800000
传真	400-888-5988	95558
注册地址	021-20899008	010-85230024
	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 东南路 256 号 36-37 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200120	100020
法定代表人	李高峰	朱鹤新

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	泰信行业精选混合 A	泰信行业精选混合 C
本期已实现收益	26,615,474.21	7,628,218.59
本期利润	11,335,598.98	-9,659,229.61
加权平均基金份 额本期利润	0.1101	-0.3443
本期加权平均净 值利润率	5.45%	-16.32%
本期基金份额净 值增长率	34.14%	34.02%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	119,641,408.89	38,260,279.77
期末可供分配基 金份额利润	0.6442	0.6423
期末基金资产净 值	388,358,689.15	124,429,605.84

期末基金份额净值	2.091	2.089
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	143.79%	118.22%

注：1、本基金基金合同自 2015 年 3 月 4 日转型生效。本基金自 2016 年 5 月 5 日起增加 C 类份额。

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

泰信行业精选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.53%	2.49%	0.85%	0.48%	-0.32%	2.01%
过去三个月	13.22%	2.74%	-2.20%	0.45%	15.42%	2.29%
过去六个月	34.14%	2.20%	0.65%	0.46%	33.49%	1.74%
过去一年	39.59%	1.94%	-6.35%	0.54%	45.94%	1.40%
过去三年	38.43%	1.75%	1.65%	0.66%	36.78%	1.09%
自基金合同生效起至今	143.79%	1.51%	27.61%	0.78%	116.18%	0.73%

泰信行业精选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.53%	2.49%	0.85%	0.48%	-0.32%	2.01%
过去三个月	13.18%	2.74%	-2.20%	0.45%	15.38%	2.29%
过去六个月	34.02%	2.20%	0.65%	0.46%	33.37%	1.74%
过去一年	39.46%	1.93%	-6.35%	0.54%	45.81%	1.39%

过去三年	38.30%	1.75%	1.65%	0.66%	36.65%	1.09%
自基金合同生效起 至今	118.22%	1.63%	27.66%	0.64%	90.56%	0.99%

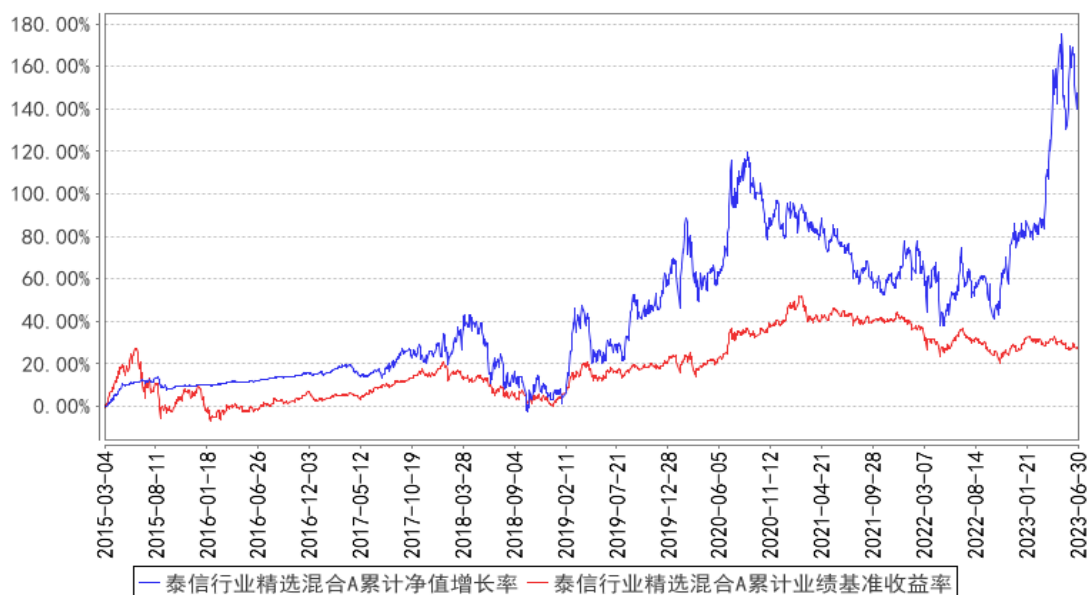
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%；本基金自 2016 年 5 月 5 日起增加 C 类份额。

1、沪深 300 指数由中国 A 股各行业上市公司中最具流动性的 300 家公司编制而成，能够全面反映股票市场的波动，是股票市场中风险收益特征较好的指数之一。

2、上证国债指数样本涵盖了上海证券交易所所有的国债品种，交易所的国债交易市场具有参与主体丰富、竞价交易连续的特性，能反映出市场利率的瞬息变化，也使得上证国债指数能真实地標示出利率市场整体的收益风险度。

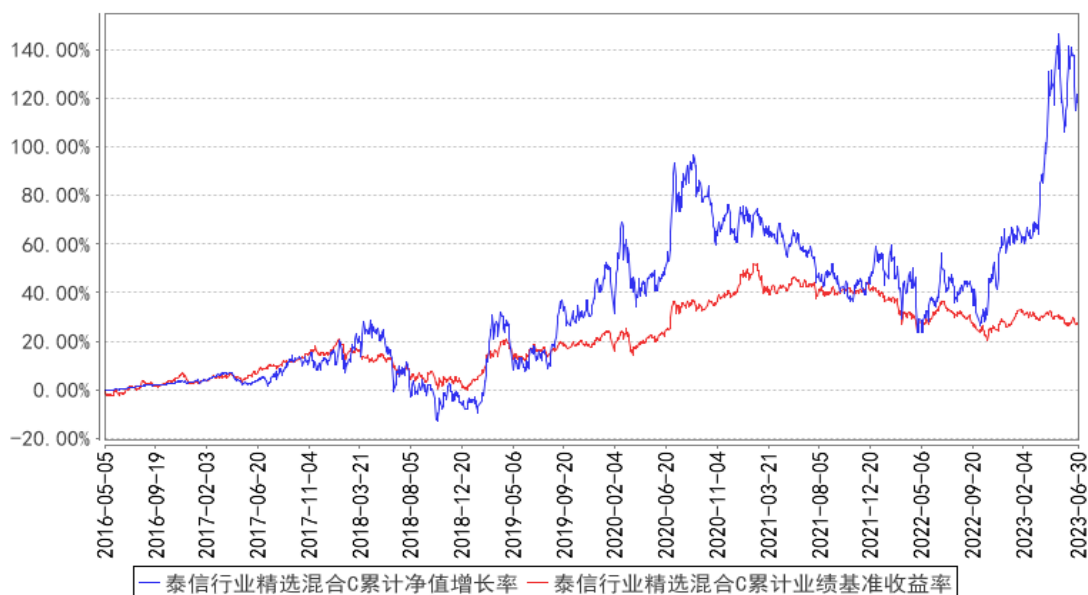
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰信行业精选混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





泰信行业精选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同自 2015 年 3 月 4 日转型生效。

2、经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，自 2016 年 5 月 5 日起泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额，并对本基金的基金合同及托管协议作相应修改。

3、经泰信行业精选混合型证券投资基金 2015 年 8 月 28 日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过，并报中国证监会备案，泰信行业精选混合型证券投资基金变更为泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金。自 2015 年 9 月 1 日起，由《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金的投资组合比例调整为：“本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券”，业绩比较基准不变。

4、本基金系原泰信保本混合型证券投资基金保本到期转型而来。根据《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，该基金的保本期为三年。保本周期到期后，依据《基金合同》规定，本基金未能符合保本基金存续条件，该基金转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名称变更为“泰信行业精选混合型证券投资基金”。自 2015 年 3 月 4 日起，《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》转型生效。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：李高峰

总经理：高宇

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：徐磊

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是“好人举手”制度下，获准筹建的第一家以信托公司为主发起人的基金管理公司。2021 年 9 月 2 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]2848 号文核准，山东省国际信托股份有限公司将其持有的 45%股权转让给山东省鲁信投资控股集团有限公司。目前，公司注册资本为 2 亿元人民币，股东为山东省鲁信投资控股集团有限公司、江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、营销支持中心、产品研发部、渠道服务部、战略客户部、机构业务部、深圳分公司、北京分公司、金融科技部、权益投资部、固收投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2023 年 6 月末，公司有正式员工 110 人，多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

截至 2023 年 6 月 30 日，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信基本面 400、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策

驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长混合、泰信鑫利混合、泰信竞争优势混合、泰信景气驱动 12 个月持有期混合、泰信汇享利率债债券、泰信低碳经济混合发起式、泰信均衡价值混合、泰信汇利三个月定开债券、泰信医疗服务混合发起式、泰信添利 30 天持有期债券发起式、泰信鑫瑞债券发起式、泰信汇盈债券、泰信优势领航、泰信添鑫中短债、泰信汇鑫三个月定开共 32 只开放式基金及 55 个资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董山青	权益投资部总监助理、泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金（原泰信保本混合型证券投资基金）基金经理、泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理、泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2012 年 2 月 22 日	-	18 年	董山青先生，香港大学工商管理专业硕士。曾任中国银行上海分行业务经理。2004 年 8 月加入泰信基金管理有限公司，历任交易员、研究员、研究总监助理、基金经理助理，现任权益投资部总监助理兼基金经理。2012 年 2 月至今任泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（原泰信保本混合型证券投资基金转型），2016 年 2 月至 2022 年 7 月任泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 8 月至 2022 年 7 月任泰信蓝筹精选混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至 2022 年 10 月任泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金经理（原泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转型），2021 年 8 月至今任泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 9 月至今任泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信行业精选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规和基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18号），公司制定了《公平交易制度》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内上证综指略有上涨，创业板指略有下跌，本基金对股市一直长期看好，因此长期维持对股票的高仓位配置。

随着消费的逐步复苏，过去三年的受损行业如传媒和文旅等行业走出向上行情，本基金在上

述困境反转板块的仓位保持稳定，同时也配置了元宇宙、AIGC、影视、游戏和 ChatGPT 等新技术驱动的板块，随着春节后 AI 人工智能在市场上的兴起，本基金也取得了一定收益，并及时分红回报了投资者。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰信行业精选混合 A 基金份额净值为 2.091 元，本报告期基金份额净值增长率为 34.14%；截至本报告期末泰信行业精选混合 C 基金份额净值为 2.089 元，本报告期基金份额净值增长率为 34.02%；同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国的货币政策紧缩进程超预期，年底可能由紧到松，加息进程将迎来拐点，有利于改善全球流动性的紧缩预期。自俄乌冲突以来，海外政局变幻，重大意外事件可能突然出现。中美关系短期会有一定缓和，但是问题长期存在，中特估概念会有各种事件催化。前几年受影响的线下消费类板块业绩逐步复苏，可能是今年重要的投资主线。房地产困局是当前经济的主要问题，稳增长政策应该能给经济下行风险兜底，但是很难出现之前的政策反转。随着房地产政策的变化，房地产相关产业链还有一定改善空间。人工智能 AI、虚拟现实和机器人领域未来一年可能出现较大突破，带来重要的投资机会。本基金将继续坚持长期投资和价值投资，并在适当的时候继续回报持有人。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定：

1、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收益分配基准日可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收

益分配；

2、基金收益分配方式分为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按除权日各类基金份额的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

6、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 A 份额每 10 份分配 0.700 元，利润分配合计 11,879,178.95 元（其中，现金形式发放 10,837,570.64 元，再投资形式发放 1,041,608.31 元）；本基金 C 份额每 10 份分配 0.700 元，利润分配合计 3,818,317.31 元（其中，现金形式发放 3,194,775.52 元，再投资形式发放 623,541.79 元）。符合基金合同的约定。

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

无

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，泰信基金管理有限公司在泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，

不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，泰信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2023 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	36,640,095.23	13,533,457.01
结算备付金		2,507,961.14	86,456.35
存出保证金		140,770.98	19,851.34
交易性金融资产	6.4.7.2	481,049,040.18	128,533,021.25
其中：股票投资		481,049,040.18	128,533,021.25
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,272,153.51	1,152,423.97
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		524,610,021.04	143,325,209.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,124,310.70	416,233.72
应付赎回款		3,242,979.63	2,935,846.03
应付管理人报酬		526,767.14	119,792.00
应付托管费		109,743.14	24,956.68
应付销售服务费		11,192.68	1,391.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		27,134.40	27,134.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	779,598.36	174,666.48
负债合计		11,821,726.05	3,700,021.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	245,281,755.88	86,544,989.03
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	267,506,539.11	53,080,199.65
净资产合计		512,788,294.99	139,625,188.68
负债和净资产总计		524,610,021.04	143,325,209.92

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 2.091 元，基金份额总额 245,281,755.88 份。其中：泰信行业精选混合 A 份额净值人民币 2.091 元，份额总额 185,716,445.31 份；泰信行业精选混合 C 份额净值人民币 2.089 元，份额总额 59,565,310.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		3,708,990.99	43,718.62
1. 利息收入		95,485.63	22,598.96
其中：存款利息收入	6.4.7.9	83,275.37	22,598.96
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		12,210.26	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,587,554.51	-2,200,463.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	30,987,513.31	-2,534,306.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	600,041.20	333,843.85
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-32,567,323.43	1,688,449.21
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,593,274.28	533,133.50
<b>减：二、营业总支出</b>		2,032,621.62	646,633.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,576,058.03	470,900.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	328,345.43	98,104.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	29,016.32	140.10
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	99,201.84	77,488.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,676,369.37	-602,915.19
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,676,369.37	-602,915.19
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,676,369.37	-602,915.19

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	86,544,989.03	-	53,080,199.65	139,625,188.68
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	86,544,989.03	-	53,080,199.65	139,625,188.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	158,736,766.85	-	214,426,339.46	373,163,106.31
（一）、综合收益总额	-	-	1,676,369.37	1,676,369.37
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	158,736,766.85	-	228,447,466.35	387,184,233.20
其中：1. 基金申购款	530,747,747.47	-	638,887,724.52	1,169,635,471.99
2. 基金赎回款	-372,010,980.62	-	-410,440,258.17	-782,451,238.79
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-15,697,496.26	-15,697,496.26
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	245,281,755.88	-	267,506,539.11	512,788,294.99

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	44,245,522.71	-	22,954,244.04	67,199,766.75
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	44,245,522.71	-	22,954,244.04	67,199,766.75
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	11,173,290.07	-	7,548,532.04	18,721,822.11
(一)、综合收益总额	-	-	-602,915.19	-602,915.19
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	11,173,290.07	-	8,151,447.23	19,324,737.30
其中：1. 基金申购款	75,642,858.75	-	34,485,616.53	110,128,475.28
2. 基金赎回款	-64,469,568.68	-	-26,334,169.30	-90,803,737.98
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	55,418,812.78	-	30,502,776.08	85,921,588.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

高宇

基金管理人负责人

叶振宇

主管会计工作负责人

顾颖

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由原泰信保本混合型证券投资基金转型而来。根据《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的约定以及本基金的基金管理人发布的《关于泰信保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及泰信行业精选混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告》的规定,泰信保本混合型证券投资基金保本期于 2015 年 2 月 25 日到期。保本期到期后进入过渡期。保本周期到期操作期间为 2015 年 2 月 25 日至 2015 年 3 月 3 日。到期操作期间截止日次日,即 2015 年 3 月 4 日起“泰信保本混合型证券投资基金”转型为“泰信行业精选混合型证券投资基金”,修订后的《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人 2016 年 4 月 28 日发布的《关于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》、经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致,自 2016 年 5 月 5 日起,本基金增加收取销售服务费的 C 类基金份额,并对基金合同作相应修改。本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。无需从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;需从本类别基金资产中计提销售服务费,称为 C 类基金份额。于 2016 年 5 月 5 日起基金份额持有人原有的本基金份额全部自动转换为 A 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,合并运作,A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信行业精选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、资产支持证券、中小企业私募债券、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。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:本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,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:  $55\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+45\% \times$  上证国债指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税

[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	36,640,095.23
等于：本金	36,634,640.78
加：应计利息	5,454.45
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	36,640,095.23

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	509,980,001.42	-	481,049,040.18	-28,930,961.24
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	509,980,001.42	-	481,049,040.18	-28,930,961.24

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	600.21
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	701,539.20
其中：交易所市场	701,539.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	77,458.95
合计	779,598.36

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

泰信行业精选混合 A

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	72,135,580.18	72,135,580.18
本期申购	358,141,460.52	358,141,460.52
本期赎回 (以“-”号填列)	-244,560,595.39	-244,560,595.39
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	185,716,445.31	185,716,445.31

## 泰信行业精选混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	14,409,408.85	14,409,408.85
本期申购	172,606,286.95	172,606,286.95
本期赎回 (以“-”号填列)	-127,450,385.23	-127,450,385.23
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	59,565,310.57	59,565,310.57

注：申购含红利再投、转换入及份额级别调增数，赎回含转换出及份额级别调减数。

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

## 泰信行业精选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,675,626.82	10,576,088.77	44,251,715.59
本期利润	26,615,474.21	-15,279,875.23	11,335,598.98
本期基金份额交易产生的变动数	71,229,486.81	87,704,621.41	158,934,108.22
其中：基金申购款	215,472,563.15	211,237,524.89	426,710,088.04
基金赎回款	-144,243,076.34	-123,532,903.48	-267,775,979.82
本期已分配利润	-11,879,178.95	-	-11,879,178.95
本期末	119,641,408.89	83,000,834.95	202,642,243.84

## 泰信行业精选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,717,065.93	2,111,418.13	8,828,484.06
本期利润	7,628,218.59	-17,287,448.20	-9,659,229.61
本期基金份额交易产生的变动数	27,733,312.56	41,780,045.57	69,513,358.13



其中：基金申购款	104,236,041.90	107,941,594.58	212,177,636.48
基金赎回款	-76,502,729.34	-66,161,549.01	-142,664,278.35
本期已分配利润	-3,818,317.31	-	-3,818,317.31
本期末	38,260,279.77	26,604,015.50	64,864,295.27

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入		77,091.30
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		5,724.64
其他		459.43
合计		83,275.37

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		30,987,513.31
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		30,987,513.31

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出股票成交总额		250,845,377.48
减：卖出股票成本总额		218,754,050.34
减：交易费用		1,103,813.83
买卖股票差价收入		30,987,513.31

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	600,041.20
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	600,041.20

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-32,567,323.43
股票投资	-32,567,323.43
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-32,567,323.43

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	4,525,467.77
基金转换费收入	67,806.51
合计	4,593,274.28

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

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

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	17,951.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,142.89
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	99,201.84

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期本基金控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,576,058.03	470,900.74
其中：支付销售机构的客户维护费	699,819.92	200,169.65

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	328,345.43	98,104.31

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

日基金托管费=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**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信行业精选混合 A	泰信行业精选混合 C	合计

泰信基金管理有限公司	-	900.75	900.75
中信银行	-	-	-
合计	-	900.75	900.75
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信行业精选混合 A	泰信行业精选混合 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	-	-
中信银行	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付给销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 级份额：支付的销售服务费按前一日 C 级基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：C 级日基金销售服务费=前一日 C 级基金资产净值×0.10%÷当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	36,640,095.23	77,091.30	5,558,677.23	21,733.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

泰信行业精选混合 A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 5 月 24 日	-	2023 年 5 月 24 日	0.700	10,837,570.64	1,041,608.31	11,879,178.95	-
合计	-	-	-	0.700	10,837,570.64	1,041,608.31	11,879,178.95	-
泰信行业精选混合 C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 5 月 24 日	-	2023 年 5 月 24 日	0.700	3,194,775.52	623,541.79	3,818,317.31	-
合计	-	-	-	0.700	3,194,775.52	623,541.79	3,818,317.31	-

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	47	1,312.71	1,552.41	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	154	1,829.52	3,237.08	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	62	1,170.56	1,215.20	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	51	1,054.68	1,299.99	-

001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	71	1,091.98	1,055.77	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	23	1,023.04	908.04	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	72	2,076.48	2,216.16	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	97	3,996.40	4,140.93	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	57	3,220.50	3,017.01	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内	认购新发股票	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	131	6,550.00	4,023.01	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内	认购新发股票	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	508	15,351.76	12,954.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	31.41	25.10	128	4,020.38	3,212.80	-
301292	海科新源	2023-06-29	1个月内	认购新发股票	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	127	3,759.20	9,070.34	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	156	5,045.04	4,970.16	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	64	4,305.92	4,187.52	-
301320	豪江	2023年6月	6个月	新股流	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-

	智能	1 日		通受限							
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	87.41	53.24	54	4,719.96	2,874.96		-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08		-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	64	4,915.20	6,908.80		-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	291	4,309.71	3,995.43		-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	96	3,129.60	2,915.52		-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	47	3,452.15	2,192.08		-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	161	3,826.97	6,905.29		-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	51	3,665.88	4,722.60		-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	121	4,081.33	3,853.85		-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	147	3,498.60	4,827.48		-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	46.16	35.72	435	20,079.60	15,538.20		-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	114	3,418.86	2,712.06		-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内	认购新发股票	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68		-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60		-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	336	17,898.72	13,507.20		-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	187	4,637.60	8,199.95		-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	115	3,030.25	3,519.00		-
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	28.75	21.02	194	5,577.50	4,077.88		-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	165	3,298.35	2,788.50		-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内	认购新发股票	57.66	57.66	2,997	172,807.02	172,807.02		-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	333	19,200.78	19,200.78		-



301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内	认购新发股票	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	811	11,483.76	13,146.31	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	130	3,068.00	8,407.10	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	1,545	17,149.50	26,326.80	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	345	15,066.15	18,302.25	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	250	3,170.00	5,577.50	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	431	13,042.06	10,917.23	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	525	14,038.50	21,357.00	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	881	9,849.58	12,853.79	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内	认购新发股票	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	99	12,462.12	8,592.21	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中

基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选

择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息。

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

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

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

2023 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.23%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为人民币 517,510,870.40 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，包括利率风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	36,640,095.23	-	-	-	36,640,095.23
结算备付金	2,507,961.14	-	-	-	2,507,961.14
存出保证金	140,770.98	-	-	-	140,770.98
交易性金融资产	-	-	-	481,049,040.18	481,049,040.18
应收申购款	-	-	-	4,272,153.51	4,272,153.51
资产总计	39,288,827.35	-	-	485,321,193.69	524,610,021.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,242,979.63	3,242,979.63
应付管理人报酬	-	-	-	526,767.14	526,767.14

应付托管费	-	-	-	109,743.14	109,743.14
应付清算款	-	-	-	7,124,310.70	7,124,310.70
应付销售服务费	-	-	-	11,192.68	11,192.68
应交税费	-	-	-	27,134.40	27,134.40
其他负债	-	-	-	779,598.36	779,598.36
负债总计	-	-	-	11,821,726.05	11,821,726.05
利率敏感度缺口	39,288,827.35	-	-	-473,499,467.64	512,788,294.99
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,533,457.01	-	-	-	13,533,457.01
结算备付金	86,456.35	-	-	-	86,456.35
存出保证金	19,851.34	-	-	-	19,851.34
交易性金融资产	-	-	-	-128,533,021.25	128,533,021.25
应收申购款	-	-	-	1,152,423.97	1,152,423.97
资产总计	13,639,764.70	-	-	-129,685,445.22	143,325,209.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,935,846.03	2,935,846.03
应付管理人报酬	-	-	-	119,792.00	119,792.00
应付托管费	-	-	-	24,956.68	24,956.68
应付清算款	-	-	-	416,233.72	416,233.72
应付销售服务费	-	-	-	1,391.93	1,391.93
应交税费	-	-	-	27,134.40	27,134.40
其他负债	-	-	-	174,666.48	174,666.48
负债总计	-	-	-	3,700,021.24	3,700,021.24
利率敏感度缺口	13,639,764.70	-	-	-125,985,423.98	139,625,188.68

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

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

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	481,049,040.18	93.81	128,533,021.25	92.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	481,049,040.18	93.81	128,533,021.25	92.06

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5%，其他变量不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）	
1. 业绩比较基准上升 5%	31,817,374.63	7,329,916.40	
2. 业绩比较基准下降 5%	-31,817,374.63	-7,329,916.40	

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	479,847,055.74	128,416,996.25
第二层次	779,520.78	116,025.00
第三层次	422,463.66	-
合计	481,049,040.18	128,533,021.25

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	481,049,040.18	91.70
	其中：股票	481,049,040.18	91.70
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	39,148,056.37	7.46
8	其他各项资产	4,412,924.49	0.84
9	合计	524,610,021.04	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	502.00	0.00
C	制造业	94,607,045.52	18.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,029.47	0.01
E	建筑业	124,245.00	0.02
F	批发和零售业	109,508.08	0.02
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	25,799,946.12	5.03
J	金融业	815,299.00	0.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,794,652.26	6.01
M	科学研究和技术服务业	2,147,509.31	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	1,282.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,574,829.00	1.28
Q	卫生和社会工作	1,831,436.34	0.36
R	文化、体育和娱乐业	318,205,756.08	62.05
S	综合	-	-
	合计	481,049,040.18	93.81

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002739	万达电影	4,508,150	56,532,201.00	11.02



2	603103	横店影视	3,099,860	52,201,642.40	10.18
3	300251	光线传媒	6,161,880	49,849,609.20	9.72
4	002292	奥飞娱乐	4,042,504	40,344,189.92	7.87
5	600977	中国电影	2,821,500	39,642,075.00	7.73
6	601599	浙文影业	9,834,300	36,976,968.00	7.21
7	002343	慈文传媒	4,406,836	33,403,816.88	6.51
8	300133	华策影视	4,346,000	30,813,140.00	6.01
9	000892	欢瑞世纪	5,767,100	25,144,556.00	4.90
10	002707	众信旅游	1,634,542	12,308,101.26	2.40
11	600637	东方明珠	1,464,300	11,450,826.00	2.23
12	300063	天龙集团	1,961,000	8,491,130.00	1.66
13	600715	文投控股	3,706,600	8,376,916.00	1.63
14	000156	华数传媒	891,600	7,756,920.00	1.51
15	600959	江苏有线	2,213,800	7,482,644.00	1.46
16	003032	传智教育	400,000	5,828,000.00	1.14
17	002712	思美传媒	850,000	5,576,000.00	1.09
18	688181	八亿时空	177,845	5,013,450.55	0.98
19	300651	金陵体育	141,200	3,810,988.00	0.74
20	300528	幸福蓝海	345,200	3,110,252.00	0.61
21	002878	元隆雅图	166,100	2,946,614.00	0.57
22	300182	捷成股份	421,500	2,659,665.00	0.52
23	002456	欧菲光	438,600	2,456,160.00	0.48
24	600229	城市传媒	286,700	2,442,684.00	0.48
25	301025	读客文化	170,000	2,077,400.00	0.41
26	300043	星辉娱乐	541,500	2,019,795.00	0.39
27	000710	贝瑞基因	171,900	1,961,379.00	0.38
28	301060	兰卫医学	105,400	1,822,366.00	0.36
29	688772	珠海冠宇	83,268	1,677,850.20	0.33
30	600037	歌华有线	161,300	1,340,403.00	0.26
31	603825	华扬联众	100,100	1,330,329.00	0.26
32	603598	引力传媒	100,000	1,046,000.00	0.20
33	300027	华谊兄弟	367,900	1,026,441.00	0.20
34	603999	读者传媒	144,500	1,010,055.00	0.20
35	300291	百纳千成	138,600	975,744.00	0.19
36	300719	安达维尔	62,800	886,736.00	0.17
37	601929	吉视传媒	448,100	824,504.00	0.16
38	600825	新华传媒	121,400	586,362.00	0.11
39	600730	中国高科	87,800	543,482.00	0.11
40	002291	遥望科技	40,000	524,000.00	0.10
41	002402	和而泰	30,000	509,400.00	0.10
42	300248	新开普	48,800	508,984.00	0.10
43	600831	广电网络	83,000	498,000.00	0.10
44	301296	新巨丰	29,500	497,960.00	0.10

45	002027	分众传媒	61,300	417,453.00	0.08
46	601658	邮储银行	82,600	403,914.00	0.08
47	000783	长江证券	66,600	386,280.00	0.08
48	601098	中南传媒	33,300	386,280.00	0.08
49	001323	慕思股份	7,800	264,888.00	0.05
50	688582	芯动联科	5,249	242,676.40	0.05
51	002607	中公教育	42,700	200,690.00	0.04
52	301486	致尚科技	3,330	192,007.80	0.04
53	000681	视觉中国	10,100	185,739.00	0.04
54	301213	观想科技	4,200	181,020.00	0.04
55	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
56	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.02
57	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
58	688084	晶品特装	1,200	104,244.00	0.02
59	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
60	600827	百联股份	7,600	101,612.00	0.02
61	688179	阿拉丁	3,200	95,552.00	0.02
62	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
63	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
64	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
65	601186	中国铁建	5,400	53,190.00	0.01
66	601390	中国中铁	6,900	52,302.00	0.01
67	300671	富满微	1,100	44,946.00	0.01
68	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
69	688271	联影医疗	200	27,602.00	0.01
70	688472	阿特斯	1,545	26,326.80	0.01
71	600030	中信证券	1,000	19,780.00	0.00
72	603489	八方股份	280	19,633.60	0.00
73	688543	国科军工	345	18,302.25	0.00
74	300676	华大基因	300	17,997.00	0.00
75	688133	泰坦科技	200	17,038.00	0.00
76	301302	华如科技	450	16,560.00	0.00
77	001282	三联锻造	464	16,439.31	0.00
78	688222	成都先导	1,000	15,660.00	0.00
79	301383	天键股份	435	15,538.20	0.00
80	002941	新疆交建	1,000	15,480.00	0.00
81	300673	佩蒂股份	1,100	15,400.00	0.00
82	301397	溯联股份	336	13,507.20	0.00
83	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
84	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
85	688334	西高院	811	13,146.31	0.00
86	301262	海看股份	508	12,954.00	0.00
87	688593	新相微	881	12,853.79	0.00

88	688343	云天励飞	200	12,722.00	0.00
89	301230	泓博医药	280	12,572.00	0.00
90	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
91	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
92	688570	天玛智控	431	10,917.23	0.00
93	688315	诺禾致源	400	10,620.00	0.00
94	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
95	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
96	688626	翔宇医疗	200	9,102.00	0.00
97	301293	三博脑科	127	9,070.34	0.00
98	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
99	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
100	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
101	688623	双元科技	99	8,592.21	0.00
102	688361	中科飞测	130	8,407.10	0.00
103	301419	阿莱德	187	8,199.95	0.00
104	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
105	301325	曼恩斯特	64	6,908.80	0.00
106	301358	湖南裕能	161	6,905.29	0.00
107	688297	中无人机	126	6,462.54	0.00
108	688562	航天软件	250	5,577.50	0.00
109	300860	锋尚文化	100	5,544.00	0.00
110	002995	天地在线	160	5,300.80	0.00
111	002624	完美世界	300	5,067.00	0.00
112	301307	美利信	156	4,970.16	0.00
113	301382	蜂助手	147	4,827.48	0.00
114	300280	紫天科技	100	4,777.00	0.00
115	301360	荣旗科技	51	4,722.60	0.00
116	002605	姚记科技	100	4,643.00	0.00
117	300770	新媒股份	100	4,586.00	0.00
118	601595	上海电影	160	4,521.60	0.00
119	603258	电魂网络	100	4,251.00	0.00
120	301310	鑫宏业	64	4,187.52	0.00
121	301141	中科磁业	97	4,140.93	0.00
122	301159	三维天地	100	4,108.00	0.00
123	301429	森泰股份	194	4,077.88	0.00
124	301246	宏源药业	131	4,023.01	0.00
125	301332	德尔玛	291	3,995.43	0.00
126	301373	凌玮科技	121	3,853.85	0.00
127	301061	匠心家居	100	3,695.00	0.00
128	301428	世纪恒通	115	3,519.00	0.00
129	002555	三七互娱	100	3,488.00	0.00
130	601800	中国交建	300	3,273.00	0.00

131	001287	中电港	154	3,237.08	0.00
132	301281	科源制药	128	3,212.80	0.00
133	301157	华塑科技	57	3,017.01	0.00
134	301337	亚华电子	96	2,915.52	0.00
135	301322	绿通科技	54	2,874.96	0.00
136	603233	大参林	100	2,801.00	0.00
137	300609	汇纳科技	100	2,800.00	0.00
138	301439	泓淋电力	165	2,788.50	0.00
139	002268	电科网安	100	2,787.00	0.00
140	301386	未来电器	114	2,712.06	0.00
141	000526	学大教育	100	2,657.00	0.00
142	301365	矩阵股份	150	2,469.00	0.00
143	002858	力盛体育	100	2,294.00	0.00
144	300612	宣亚国际	100	2,249.00	0.00
145	300898	熊猫乳品	100	2,238.00	0.00
146	001380	华纬科技	72	2,216.16	0.00
147	301345	涛涛车业	47	2,192.08	0.00
148	300845	捷安高科	100	2,173.00	0.00
149	002773	康弘药业	100	1,912.00	0.00
150	300235	方直科技	150	1,867.50	0.00
151	603108	润达医疗	100	1,858.00	0.00
152	603721	中广天择	100	1,855.00	0.00
153	688277	天智航	100	1,844.00	0.00
154	600062	华润双鹤	100	1,742.00	0.00
155	600757	长江传媒	200	1,720.00	0.00
156	600835	上海机电	100	1,718.00	0.00
157	600633	浙数文化	100	1,621.00	0.00
158	601577	长沙银行	200	1,552.00	0.00
159	603729	龙韵股份	100	1,493.00	0.00
160	300426	唐德影视	100	1,489.00	0.00
161	603636	南威软件	100	1,467.00	0.00
162	001328	登康口腔	51	1,299.99	0.00
163	603099	长白山	100	1,282.00	0.00
164	001324	长青科技	62	1,215.20	0.00
165	600640	国脉文化	100	1,201.00	0.00
166	000719	中原传媒	100	1,170.00	0.00
167	601928	凤凰传媒	100	1,140.00	0.00
168	300081	恒信东方	100	1,076.00	0.00
169	001360	南矿集团	71	1,055.77	0.00
170	601801	皖新传媒	100	939.00	0.00
171	001330	博纳影业	100	928.00	0.00
172	001367	海森药业	23	908.04	0.00
173	002599	盛通股份	100	905.00	0.00

174	002424	贵州百灵	100	898.00	0.00
175	000848	承德露露	100	885.00	0.00
176	603887	城地香江	100	872.00	0.00
177	601921	浙版传媒	100	869.00	0.00
178	300805	电声股份	100	835.00	0.00
179	600576	祥源文旅	100	797.00	0.00
180	300299	富春股份	100	784.00	0.00
181	600919	江苏银行	100	735.00	0.00
182	000917	电广传媒	100	731.00	0.00
183	603009	北特科技	100	712.00	0.00
184	000676	智度股份	100	701.00	0.00
185	000543	皖能电力	100	660.00	0.00
186	002966	苏州银行	100	655.00	0.00
187	000665	湖北广电	100	562.00	0.00
188	300148	天舟文化	100	552.00	0.00
189	600015	华夏银行	100	541.00	0.00
190	600908	无锡银行	100	536.00	0.00
191	600023	浙能电力	100	507.00	0.00
192	600497	驰宏锌锗	100	502.00	0.00
193	000166	申万宏源	100	462.00	0.00
194	600052	东望时代	100	429.00	0.00
195	002122	汇洲智能	100	426.00	0.00
196	002839	张家港行	100	423.00	0.00
197	603323	苏农银行	100	421.00	0.00
198	600863	内蒙华电	100	415.00	0.00
199	600936	广西广电	100	383.00	0.00
200	600567	山鹰国际	100	229.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002739	万达电影	56,444,284.79	40.43
2	300251	光线传媒	52,191,927.92	37.38
3	603103	横店影视	45,454,935.00	32.55
4	600977	中国电影	36,205,732.00	25.93
5	601599	浙文影业	35,236,493.00	25.24
6	002343	慈文传媒	28,781,726.80	20.61
7	000892	欢瑞世纪	27,560,082.00	19.74
8	300133	华策影视	24,412,497.94	17.48
9	002292	奥飞娱乐	23,844,262.55	17.08
10	002707	众信旅游	15,846,533.46	11.35
11	002712	思美传媒	14,987,301.30	10.73

12	600637	东方明珠	12,453,134.04	8.92
13	002599	盛通股份	11,180,924.00	8.01
14	003032	传智教育	10,567,849.13	7.57
15	300063	天龙集团	9,675,440.00	6.93
16	600715	文投控股	9,451,118.00	6.77
17	600959	江苏有线	8,897,292.35	6.37
18	000156	华数传媒	8,781,560.00	6.29
19	001323	慕思股份	8,779,144.00	6.29
20	002605	姚记科技	6,561,392.00	4.70
21	603887	城地香江	6,410,752.40	4.59
22	300770	新媒股份	6,084,471.00	4.36
23	688181	八亿时空	5,086,805.55	3.64
24	300528	幸福蓝海	4,780,343.00	3.42
25	300651	金陵体育	4,272,754.00	3.06
26	300609	汇纳科技	4,163,531.00	2.98
27	300182	捷成股份	4,125,747.62	2.95
28	002878	元隆雅图	4,047,932.00	2.90
29	688699	明微电子	4,036,163.80	2.89
30	000676	智度股份	3,667,163.00	2.63
31	603825	华扬联众	3,570,545.00	2.56
32	688488	艾迪药业	3,449,803.84	2.47
33	002995	天地在线	3,232,247.00	2.31
34	600229	城市传媒	3,055,439.00	2.19

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超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	601595	上海电影	18,173,756.10	13.02
2	002599	盛通股份	17,281,001.00	12.38
3	002605	姚记科技	12,039,750.00	8.62
4	002712	思美传媒	8,581,339.00	6.15
5	001323	慕思股份	7,903,530.54	5.66
6	300144	宋城演艺	7,030,069.65	5.03
7	300770	新媒股份	6,392,358.00	4.58
8	600258	首旅酒店	6,311,014.92	4.52
9	002707	众信旅游	5,911,222.00	4.23
10	603887	城地香江	5,738,664.00	4.11
11	600138	中青旅	5,591,999.46	4.01
12	300609	汇纳科技	5,361,876.00	3.84
13	002995	天地在线	4,906,021.40	3.51
14	600827	百联股份	4,531,159.84	3.25
15	003032	传智教育	4,096,461.00	2.93

16	000676	智度股份	3,820,891.00	2.74
17	688699	明微电子	3,638,349.10	2.61
18	688488	艾迪药业	3,493,457.23	2.50
19	600757	长江传媒	3,172,216.00	2.27
20	603518	锦泓集团	2,997,316.00	2.15
21	300860	锋尚文化	2,853,096.00	2.04

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	603,837,392.70
卖出股票收入（成交）总额	250,845,377.48

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末本基金未投资贵金属。

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

报告期末本基金未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

光线传媒于 2023 年 1 月 13 日发布公告，收到中国证监会北京监管局出具的《关于对北京光线传媒股份有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定》（〔2023〕20 号），公司对外投资财务核算不规范，构成业绩预告披露不准确。本基金管理人认为对公司主营业务、收入、净利润不构成重大影响，同时不构成退市风险。公司作为中国影视业的龙头，企业经营有望继续保持良好。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	140,770.98
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,272,153.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,412,924.49

### 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

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者



	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
泰信行业 精选混合 A	46,854	3,963.73	44,501.84	0.02	185,671,943.47	99.98
泰信行业 精选混合 C	5,343	11,148.29	3,484,183.28	5.85	56,081,127.29	94.15
合计	52,197	4,699.15	3,528,685.12	1.44	241,753,070.76	98.56

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰信行业精选混合 A	961,625.03	0.5178
	泰信行业精选混合 C	45,756.40	0.0768
	合计	1,007,381.43	0.4107

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	泰信行业精选混合 A	0
	泰信行业精选混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	泰信行业精选混合 A	50~100
	泰信行业精选混合 C	0
	合计	50~100

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信行业精选混合 A	泰信行业精选混合 C
基金合同生效日 (2015 年 3 月 4 日) 基金份额总额	279,050,292.85	-
本报告期期初基金份 额总额	72,135,580.18	14,409,408.85
本报告期基金总申购	358,141,460.52	172,606,286.95

份额		
减：本报告期基金总赎回份额	244,560,595.39	127,450,385.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	185,716,445.31	59,565,310.57

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金管理人的重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

			(%)		(%)	
海通证券	2	849,767,386.01	100.00	786,063.02	100.00	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对交易单元租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本报告期内本基金新增交易单元：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(%)
海通证券	-	-	195,222,000.00	100.00	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分开放式基金新增博时财富为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2023年1月12日
2	关于旗下部分开放式基金新增博时财富为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2023年1月16日
3	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年 4 季度报告	《上海证券报》、规定网站	2023年1月19日
4	关于旗下部分开放式基金新增北京汇成基金销售有限公司为销售机构并开通转换及定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2023年2月23日
5	关于旗下部分开放式基金新增南京证券股份有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2023年3月3日

6	关于旗下部分开放式基金在中信证券、中信证券（山东）、中信证券华南参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 3 月 6 日
7	关于旗下部分开放式基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 3 月 9 日
8	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 1 号）、产品资料概要更新	《上海证券报》、规定网站	2023 年 3 月 11 日
9	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 3 月 30 日
10	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年 1 季度报告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 4 月 21 日
11	关于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金新增天风证券股份有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 4 月 26 日
12	关于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额新增江海证券有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 4 月 27 日
13	关于旗下部分开放式基金在上海浦东发展银行股份有限公司开通转换、定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 4 月 28 日
14	关于旗下部分开放式基金在中信期货有限公司参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 5 月 12 日
15	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资业务公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 5 月 17 日
16	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金取消 C 类份额申购费并修改招募说明书的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 5 月 19 日
17	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 2 号）、产品资料概要更新	《上海证券报》、规定网站	2023 年 5 月 19 日
18	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金调整机构投资者大额申购、转换转入、定期定额投资限制公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 5 月 19 日
19	关于旗下部分开放式基金新增平安银行股份有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 5 月 22 日

20	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金分红公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 5 月 23 日
21	关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 5 月 26 日
22	关于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 C 类新增销售机构并开通转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 5 月 29 日
23	关于旗下部分开放式基金新增京东肯特瑞基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 5 月 30 日
24	关于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金新增爱建证券有限责任公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 6 月 13 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者的投资需求，降低投资者的投资成本，经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，泰信基金管理有限公司决定自 2023 年 5 月 22 日起，取消泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额（基金代码：002583）的申购费。同时，相应修订《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关条款。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、原中国证监会批准泰信保本混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信行业精选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、报告期内本基金在规定媒介对外披露的各项公告

### 12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人住所（或办公场所）、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

在支付必要的工本费后，投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

### 12.3 查阅方式

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

泰信基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日