泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金2018年半年度报告

2018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：2018年8月25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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2

1.2 目录 3

§2 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

§3 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

§4 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 13

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15

6.1 资产负债表 15

6.2 利润表 16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17

6.4 报表附注.....18
§7 投资组合报告.....39
7.1 期末基金资产组合情况.....39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....39
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.....41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....53
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.....53
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.....53
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.....53
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.....53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....54
7.12 投资组合报告附注.....54
§8 基金份额持有人信息.....56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....56
8.2 期末上市基金前十名持有人.....56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....57
§9 开放式基金份额变动.....58
§10 重大事件揭示.....59
10.1 基金份额持有人大会决议.....59
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.....59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....59
10.4 基金投资策略的改变.....59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....59
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.....59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....59
10.8 其他重大事件.....61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....69

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 69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 69
§12 备查文件目录 70
12.1 备查文件目录 70
12.2 存放地点 70
12.3 查阅方式 70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金		
基金简称	泰信基本面 400 指数分级		
场内简称	泰信 400		
基金主代码	162907		
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2012 年 9 月 7 日		
基金管理人	泰信基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	45,423,797.07 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 9 月 21 日		
下属分级基金的基金简称	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
下属分级基金场内简称:	泰信 400A	泰信 400B	泰信 400
下属分级基金的交易代码	150094	150095	162907
报告期末下属分级基金份额总额	762,891.00 份	762,891.00 份	43,898,015.07 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人

名称		泰信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	郭明
	联系电话	021-20899098	（010）66105798
	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）66105799
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	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-36,069.69
本期利润	-8,657,823.13
加权平均基金份额本期利润	-0.1153
本期加权平均净值利润率	-16.05%
本期基金份额净值增长率	-15.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	14,176,418.57
期末可供分配基金份额利润	0.3121
期末基金资产净值	45,265,385.33
期末基金份额净值	0.997
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	45.52%

注：1、本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。

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

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

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

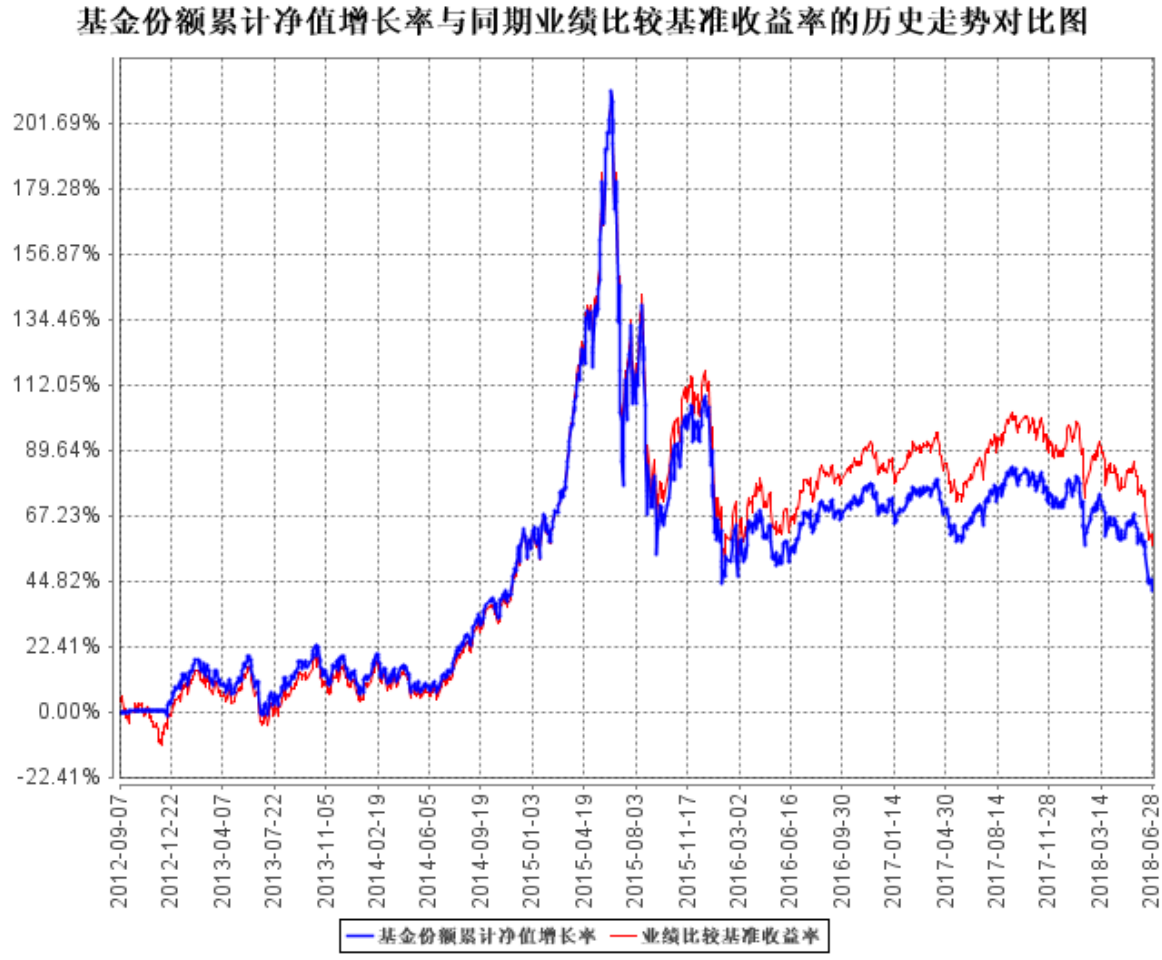
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-9.18%	1.64%	-9.37%	1.68%	0.19%	-0.04%
过去三个月	-12.66%	1.28%	-12.95%	1.30%	0.29%	-0.02%
过去六个月	-15.66%	1.37%	-15.54%	1.37%	-0.12%	0.00%
过去一年	-13.83%	1.15%	-12.74%	1.16%	-1.09%	-0.01%
过去三年	-40.93%	1.83%	-35.46%	1.81%	-5.47%	0.02%
自基金合同	45.52%	1.65%	60.81%	1.67%	-15.29%	-0.02%

生效起至今						

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

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

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



注：1、本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：万众

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：姚慧

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co.，Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、产品部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2018 年 6 月底，公司有正式员工 100 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 2018 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 9 个资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张彦先生	本基金经理兼泰信中证 200 指数基金、泰信智选成长混合基金经理	2015 年 1 月 6 日	-	12 年	研究生硕士。具有基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，担任高级研究员。自 2011 年 10 月至 2014 年 5 月任泰信中小盘精选基金经理助理。2012 年 4 月至 2015 年 1 月任泰信优势增长混合基金经理助理。自 2015 年 1 月 6 日起同时担任泰信中证 200 指数基金经理；自 2017 年 11 月 15 日起担任泰信智选成长混合基金经理。

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行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可

疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 上半年，中美贸易战愈演愈烈，在经济增速降缓，货币政策中性偏紧，金融严监管去杠杆的背景下， A 股市场呈现单边下跌的态势，上证综指下跌 13.9%，深证成指下跌 15.04%，中小板下跌 14.26%，创业板下跌 8.33%。从行业看，上半年仅有餐饮旅游、食品饮料和医药三个行业上涨，其他板块具有较大的跌幅。

报告期内，本基金作为被动操作的指数基金,严格执行基金合同规定的投资策略,按照规定的投资策略和方法进行投资操作,努力拟合标的指数,减小跟踪误差，报告期内跟踪误差控制在 1%。报告期跟踪误差主要是由于基金申购赎回和标的指数成分股定期调整等因素所造成。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.997 元；本报告期基金份额净值增长率为-15.66%，业绩比较基准收益率为-15.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，二季度经济增速如期回落，下半年经济下行压力确认。影响下半年经济主要是两个因素，一个是贸易战，另一个是去年三季度以来的信用收缩。从贸易战的角度来看，从 500 亿美元商品扩大到 2500 亿美元影响 GDP 将更加明显。信用收缩从去年三四季度开始，已经持续了 3 个季度，社融增速从 13.2%下降到 9.8%，出现了快速下行，将对内需产生明显的收缩。当前政策已经开始转变，7 月 31 日政治局会议“稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、 稳投资、稳预期”

基调，货币政策方面，已经出现一系列的边际宽松、稳定预期的措施，预计后续会更好的把握去杠杆政策执行的节奏和力度。保证了中国经济不至于出现硬着陆的危机。

大盘反弹缺乏基本面有力支撑。市场风险偏好的提升还要看积极的财政政策如何更积极以及各项改革的推进。在内部和外部两大因素消除之前，市场预计仍将保持震荡磨底。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生，本科学历。2002 年加入泰信基金管理公司，现任公司副总经理。

委员会成员：

张敬燕女士，硕士。2017 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部副总监。

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

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

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

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

报告截止日： 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,635,337.93	2,313,768.87
结算备付金		-	41,499.87
存出保证金		205.82	11,570.18
交易性金融资产	6.4.7.2	43,224,566.65	53,563,048.13
其中：股票投资		43,224,566.65	53,563,048.13
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		-	1,093,599.16
应收利息	6.4.7.5	792.24	695.18
应收股利		-	-
应收申购款		1,992.27	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		47,862,894.91	57,024,181.39
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2018 年 6 月 30 日**	**上年度末 2017 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		-	-
应付赎回款		2,382,935.07	2,333.73
应付管理人报酬		40,745.74	49,330.02
应付托管费		8,964.05	10,852.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	23,930.83	8,599.13

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	140,933.89	174,739.95
负债合计		2,597,509.58	245,855.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	31,088,966.76	32,997,977.88
未分配利润	6.4.7.10	14,176,418.57	23,780,348.07
所有者权益合计		45,265,385.33	56,778,325.95
负债和所有者权益总计		47,862,894.91	57,024,181.39

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额净值 0.997 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额净值 1.001 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额净值 0.993 元；基金份额总额 45,423,797.07 份，其中泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额 43,898,015.07 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额 762,891.00 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额 762,891.00 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-8,135,980.58	514,808.75
1.利息收入		12,357.95	13,264.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,357.95	13,264.67
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		467,917.17	-84,409.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-21,625.53	-398,766.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	489,542.70	314,356.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,621,753.44	566,750.06
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	5,497.74	19,203.64
减：二、费用		521,842.55	465,792.70
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	267,060.52	222,136.36
2．托管费	6.4.10.2.2	58,753.31	48,870.00
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	41,088.54	38,137.38
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	154,940.18	156,648.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,657,823.13	49,016.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,657,823.13	49,016.05

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	32,997,977.88	23,780,348.07	56,778,325.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,657,823.13	-8,657,823.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,909,011.12	-946,106.37	-2,855,117.49
其中：1.基金申购款	574,926.55	306,398.43	881,324.98

2.基金赎回款	-2,483,937.67	-1,252,504.80	-3,736,442.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	31,088,966.76	14,176,418.57	45,265,385.33
项目	**上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	26,069,783.67	17,879,883.46	43,949,667.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,016.05	49,016.05
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）	5,353,319.66	3,567,287.86	8,920,607.52
其中：1.基金申购款	14,248,772.89	10,225,957.79	24,474,730.68
2.基金赎回款	-8,895,453.23	-6,658,669.93	-15,554,123.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	31,423,103.33	21,496,187.37	52,919,290.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

葛航　　韩波　　蔡海成

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 252 号《关于核准泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金募集的批复》核准，由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本

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

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

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

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

份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1：1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则－基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信中

证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴

纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	4,635,337.93
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：	4,635,337.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		51,722,333.23	43,224,566.65	-8,497,766.58
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		51,722,333.23	43,224,566.65	-8,497,766.58

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	792.15
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	-
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	0.09
合计	792.24

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	23,930.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	23,930.83

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,980.90
预提费用	119,011.12
应付指数使用费	12,941.87
-	-
合计	140,933.89

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,301,291.40	32,997,977.88
本期申购	3,161,225.00	263,854.64
本期赎回 (以"-"号填列)	-1,707,957.19	-724,181.14
2018 年 6 月 20 日 基金拆分/份额折算前	76,754,559.21	32,537,651.38
基金拆分/份额折算变动份额	-29,213,562.06	-

本期申购	454,611.19	311,071.91
本期赎回 (以"-"号填列)	-2,571,811.27	-1,759,756.53
本期末	45,423,797.07	31,088,966.76

注：(1) 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2018 年 6 月 20 日为份额折算基准日，对泰信基本面 400 的基础份额以及泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额实施不定期份额折算。

(2) 根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回泰信基本面 400 份额，泰信基本面 400A 和泰信基本面 400B 份额只可深圳交易所上市交易，因此上表不再单独披露泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的情况。

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	21,306,642.58	2,473,705.49	23,780,348.07
本期利润	-36,069.69	-8,621,753.44	-8,657,823.13
本期基金份额交易产生的变动数	-1,228,237.82	282,131.45	-946,106.37
其中：基金申购款	369,149.33	-62,750.90	306,398.43
基金赎回款	-1,597,387.15	344,882.35	-1,252,504.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,042,335.07	-5,865,916.50	14,176,418.57

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,754.52
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	28.21
其他	575.22
合计	12,357.95

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	14,175,742.28
减：卖出股票成本总额	14,197,367.81
买卖股票差价收入	-21,625.53

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期末本基金未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期本基金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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	489,542.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	489,542.70

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-8,621,753.44
——股票投资	-8,621,753.44
——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	-8,621,753.44

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,497.74
合计	5,497.74

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，本基金收取的赎回费中不低于 25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	41,088.54
银行间市场交易费用	-
合计	41,088.54

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,505.56
债券帐户维护费——中债登	9,000.00
指数使用费	26,706.06
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	223.00
债券帐户维护费——上清所	-
其他	-
合计	154,940.18

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

截至本报告期末，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

本报告期无需要说明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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
山东省国际信托股份有限公司（“山东国托”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司（“青岛国信”）	基金管理人的股东

注：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

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	267,060.52	222,136.36
其中：支付销售机构的客户维护费	28,838.45	18,613.01

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	58,753.31	48,870.00

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

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间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

本报告期及上年度可比期间本基金与关联方未发生银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
期初持有的基金份额	-	-	24,010,861.29
期间申购/买入总份额	-	-	0.00
期间因拆分变动份额	-	-	-8,637,270.40
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	0.00
期末持有的基金份额	-	-	15,373,590.89
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	33.8400%

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
期初持有的基金份额	-	-	11,611,612.90
期间申购/买入总份额	-	-	12,010,284.02
期间因拆分变动份额	-	-	388,964.37
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	0.00
期末持有的基金份额	-	-	24,010,861.29
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	33.4900%

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

泰信基本面 400				
关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山东省国际信	18,634,755.83	41.0200%	29,104,230.83	38.6500%

托股份有限公司				

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

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	4,635,337.93	11,754.52	2,867,495.77	12,917.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未参与在承销期内关联方承销的证券。

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

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

6.4.12 期末（2018 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

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600811	东方集团	2018 年 5 月 30 日	重大事项	4.30	-	-	46,205	240,431.93	198,681.50	-
002210	飞马国际	2018 年 3 月 26 日	重大事项	12.33	-	-	14,534	150,042.22	179,204.22	-
600122	宏图高科	2018 年 6 月 19 日	重大事项	7.40	-	-	22,083	238,889.52	163,414.20	-
002450	康得	2018 年 6 月	重大	17.08	-	-	8,694	165,305.99	148,493.52	-

	新	4 日	事项							
300146	汤臣倍健	2018 年 1 月 31 日	重大事项	16.60	2018 年 7 月 31 日	16.50	8,788	127,844.37	145,880.80	-
002309	中利集团	2018 年 2 月 5 日	重大事项	14.30	2018 年 7 月 30 日	12.78	7,156	105,069.71	102,330.80	-
601118	海南橡胶	2018 年 5 月 24 日	重大事项	6.62	-	-	14,729	96,177.38	97,505.98	-
600751	天海投资	2018 年 1 月 12 日	重大事项	6.49	-	-	14,625	86,938.39	94,916.25	-
002310	东方园林	2018 年 5 月 25 日	重大事项	15.03	-	-	6,300	94,149.63	94,689.00	-
300072	三聚环保	2018 年 6 月 19 日	重大事项	23.28	2018 年 7 月 10 日	24.00	4,009	129,129.91	93,329.52	-
002051	中工国际	2018 年 4 月 9 日	重大事项	15.27	-	-	5,669	108,048.03	86,565.63	-
002426	胜利精密	2018 年 6 月 19 日	重大事项	3.60	2018 年 7 月 3 日	3.26	22,400	89,376.00	80,640.00	-
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	重大事项	52.04	-	-	1,500	87,300.00	78,060.00	-
002408	齐翔腾达	2018 年 6 月 19 日	重大事项	12.28	-	-	6,044	58,320.71	74,220.32	-
000939	凯迪生态	2017 年 11 月 16 日	重大事项	4.99	2018 年 7 月 2 日	4.74	14,449	67,169.13	72,100.51	-
000793	华闻传媒	2018 年 2 月 1 日	重大事项	8.40	2018 年 7 月 16 日	7.56	8,000	84,651.10	67,200.00	-
000603	盛达矿业	2018 年 6 月 11 日	重大事项	10.83	-	-	5,794	77,508.86	62,749.02	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项	14.59	-	-	4,100	88,204.18	59,819.00	-
002252	上海莱士	2018 年 2 月 23 日	重大事项	19.52	-	-	3,042	61,383.45	59,379.84	-
000666	经纬纺机	2018 年 3 月 12 日	重大事项	18.08	-	-	3,045	67,726.22	55,053.60	-
000587	金洲慈航	2018 年 6 月 15 日	重大事项	4.96	2018 年 7 月 2 日	4.46	9,830	76,296.67	48,756.80	-
000022	深赤湾 A	2017 年 11 月 20 日	重大事项	22.82	2018 年 7 月 10 日	20.55	1,876	51,691.60	42,810.32	-
002075	沙钢股份	2016 年 9 月 19 日	重大事项	16.12	-	-	2,420	44,596.14	39,010.40	-

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形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，泰信基本面 400A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；泰信基本面 400B 份额具有高风险、高预期收益的特征。本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪。力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，实现基金资产的长期增值。

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

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 2018 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 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 2018 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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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 2018 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 4.74%。

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 2018 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 45,715,093.35 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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	4,635,337.93	-	-	-	4,635,337.93
存出保证金	205.82	-	-	-	205.82
交易性金融资产	-	-	-	43,224,566.65	43,224,566.65
应收利息	-	-	-	792.24	792.24
应收申购款	-	-	-	1,992.27	1,992.27
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,635,543.75	-	-	43,227,351.16	47,862,894.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,382,935.07	2,382,935.07
应付管理人报酬	-	-	-	40,745.74	40,745.74
应付托管费	-	-	-	8,964.05	8,964.05
应付交易费用	-	-	-	23,930.83	23,930.83
其他负债	-	-	-	140,933.89	140,933.89
负债总计	-	-	-	2,597,509.58	2,597,509.58
利率敏感度缺口	4,635,543.75	-	-	40,629,841.58	45,265,385.33
上年度末 2017 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	2,313,768.87	-	-	-	2,313,768.87
结算备付金	41,499.87	-	-	-	41,499.87
存出保证金	11,570.18	-	-	-	11,570.18

交易性金融资产	-	-	-	53,563,048.13	53,563,048.13
应收证券清算款	-	-	-	1,093,599.16	1,093,599.16
应收利息	-	-	-	695.18	695.18
资产总计	2,366,838.92	-	-	54,657,342.47	57,024,181.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,333.73	2,333.73
应付管理人报酬	-	-	-	49,330.02	49,330.02
应付托管费	-	-	-	10,852.61	10,852.61
应付交易费用	-	-	-	8,599.13	8,599.13
其他负债	-	-	-	174,739.95	174,739.95
负债总计	-	-	-	245,855.44	245,855.44
利率敏感度缺口	2,366,838.92	-	-	54,411,487.03	56,778,325.95

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2017 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（2017 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的股票，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，主要采用完全复制法，按照在中证锐联基本面 400 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及 其权重的变动而进行相应调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。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。本基金投资组合中投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	43,224,566.65	95.49	53,563,048.13	94.34
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	43,224,566.65	95.49	53,563,048.13	94.34

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		
分析	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（ 2018 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2017 年 12 月 31 日 ）
	1.业绩比较基准上升 5%	2,561,013.75	2,772,516.07
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,561,013.75	-2,772,516.07

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	43,224,566.65	90.31
	其中：股票	43,224,566.65	90.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,635,337.93	9.68
8	其他各项资产	2,990.33	0.01
9	合计	47,862,894.91	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	206,608.06	0.46
B	采矿业	2,262,250.27	5.00
C	制造业	23,604,043.95	52.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,022,611.09	2.26
E	建筑业	1,574,567.89	3.48
F	批发和零售业	3,577,416.28	7.90
G	交通运输、仓储和邮政业	2,014,564.46	4.45
H	住宿和餐饮业	44,943.36	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,215,194.47	2.68
J	金融业	2,457,268.10	5.43
K	房地产业	2,926,070.23	6.46
L	租赁和商务服务业	812,583.38	1.80

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	247,551.34	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	777,832.30	1.72
S	综合	66,424.00	0.15
	合计	42,809,929.18	94.58

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	97,505.98	0.22
B	采矿业	62,749.02	0.14
C	制造业	98,829.40	0.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	72,100.51	0.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	42,810.32	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	40,642.24	0.09
S	综合	-	-
	合计	414,637.47	0.92

注：积极投资股票为被动持有非当前成分股，将逐步进行调整成分股。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

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	占基金资产净值比例（%）
1	600535	天士力	10,612	274,001.84	0.61
2	601555	东吴证券	39,543	270,078.69	0.60
3	000488	晨鸣纸业	20,900	270,028.00	0.60
4	000425	徐工机械	59,500	252,280.00	0.56
5	601168	西部矿业	39,168	245,975.04	0.54
6	601997	贵阳银行	19,551	241,650.36	0.53
7	000059	华锦股份	34,500	237,705.00	0.53
8	000878	云南铜业	24,900	237,546.00	0.52
9	600522	中天科技	26,626	234,575.06	0.52
10	600875	东方电气	31,600	234,156.00	0.52
11	600325	华发股份	30,124	232,858.52	0.51
12	600266	北京城建	24,600	231,240.00	0.51
13	600739	辽宁成大	14,962	227,123.16	0.50
14	002183	怡亚通	33,955	225,800.75	0.50
15	000623	吉林敖东	12,202	219,391.96	0.48
16	000423	东阿阿胶	4,043	217,553.83	0.48
17	000728	国元证券	29,115	215,451.00	0.48
18	002092	中泰化学	22,145	213,477.80	0.47
19	600348	阳泉煤业	29,800	213,070.00	0.47
20	600655	豫园股份	22,329	211,009.05	0.47
21	600276	恒瑞医药	2,784	210,915.84	0.47
22	600804	鹏博士	17,474	209,688.00	0.46
23	000413	东旭光电	33,751	204,531.06	0.45
24	600143	金发科技	38,889	203,000.58	0.45
25	002241	歌尔股份	19,774	201,497.06	0.45
26	000581	威孚高科	9,088	200,935.68	0.44
27	600811	东方集团	46,205	198,681.50	0.44
28	002081	金螳螂	19,540	197,354.00	0.44
29	000963	华东医药	4,087	197,197.75	0.44
30	000703	恒逸石化	12,700	188,976.00	0.42
31	000543	皖能电力	42,426	187,098.66	0.41
32	000768	中航飞机	11,908	186,241.12	0.41
33	600039	四川路桥	56,238	184,460.64	0.41

34	002456	欧菲科技	11,378	183,527.14	0.41
35	600873	梅花生物	43,820	183,167.60	0.40
36	600694	大商股份	5,600	182,056.00	0.40
37	600157	永泰能源	102,000	181,560.00	0.40
38	600507	方大特钢	16,836	179,976.84	0.40
39	601233	桐昆股份	10,431	179,621.82	0.40
40	600729	重庆百货	5,444	179,379.80	0.40
41	002210	飞马国际	14,534	179,204.22	0.40
42	600489	中金黄金	26,000	177,320.00	0.39
43	000926	福星股份	24,624	177,046.56	0.39
44	600079	人福医药	13,134	173,631.48	0.38
45	000701	厦门信达	24,829	172,313.26	0.38
46	600699	均胜电子	6,692	171,917.48	0.38
47	600782	新钢股份	30,800	171,864.00	0.38
48	600487	亨通光电	7,766	171,240.30	0.38
49	601699	潞安环能	18,400	170,384.00	0.38
50	000830	鲁西化工	9,921	169,450.68	0.37
51	600649	城投控股	27,500	168,300.00	0.37
52	600109	国金证券	23,656	168,194.16	0.37
53	300226	上海钢联	2,800	167,580.00	0.37
54	600282	南钢股份	37,642	166,377.64	0.37
55	002244	滨江集团	31,990	166,348.00	0.37
56	000690	宝新能源	23,832	165,870.72	0.37
57	600122	宏图高科	22,083	163,414.20	0.36
58	002078	太阳纸业	16,677	161,600.13	0.36
59	600426	华鲁恒升	8,971	157,799.89	0.35
60	600176	中国巨石	15,312	156,641.76	0.35
61	000750	国海证券	43,374	154,845.18	0.34
62	002008	大族激光	2,904	154,463.76	0.34
63	000528	柳工	14,304	153,195.84	0.34
64	000600	建投能源	27,500	153,175.00	0.34
65	000060	中金岭南	31,450	152,847.00	0.34
66	002475	立讯精密	6,745	152,032.30	0.34
67	002236	大华股份	6,730	151,761.50	0.34
68	002422	科伦药业	4,718	151,447.80	0.33
69	600380	健康元	12,743	151,131.98	0.33
70	601179	中国西电	43,900	150,138.00	0.33
71	000550	江铃汽车	12,300	148,953.00	0.33
72	300070	碧水源	10,690	148,911.70	0.33

73	002450	康得新	8,694	148,493.52	0.33
74	600482	中国动力	8,507	148,447.15	0.33
75	601099	太平洋	63,380	148,309.20	0.33
76	600584	长电科技	8,752	148,258.88	0.33
77	000671	阳光城	24,689	147,393.33	0.33
78	601012	隆基股份	8,783	146,588.27	0.32
79	601666	平煤股份	35,068	146,584.24	0.32
80	002110	三钢闽光	9,123	146,241.69	0.32
81	300146	汤臣倍健	8,788	145,880.80	0.32
82	000686	东北证券	22,744	145,789.04	0.32
83	000961	中南建设	23,089	145,691.59	0.32
84	600497	驰宏锌锗	26,720	145,624.00	0.32
85	600567	山鹰纸业	37,505	144,769.30	0.32
86	600970	中材国际	21,603	144,308.04	0.32
87	600252	中恒集团	44,498	144,173.52	0.32
88	601198	东兴证券	10,989	143,296.56	0.32
89	600004	白云机场	10,844	141,947.96	0.31
90	600742	一汽富维	11,595	141,806.85	0.31
91	603858	步长制药	3,263	139,623.77	0.31
92	000401	冀东水泥	15,728	139,507.36	0.31
93	600332	白云山	3,646	138,730.30	0.31
94	600816	安信信托	19,130	138,501.20	0.31
95	601098	中南传媒	10,926	138,104.64	0.31
96	600269	赣粤高速	33,500	137,015.00	0.30
97	000786	北新建材	7,390	136,936.70	0.30
98	600183	生益科技	14,858	136,099.28	0.30
99	600008	首创股份	32,188	135,833.36	0.30
100	002673	西部证券	17,909	135,212.95	0.30
101	600409	三友化工	15,625	134,531.25	0.30
102	600256	广汇能源	32,563	133,182.67	0.29
103	000792	盐湖股份	12,300	133,086.00	0.29
104	600312	平高电气	23,578	132,979.92	0.29
105	600056	中国医药	7,275	132,914.25	0.29
106	002004	华邦健康	26,124	132,709.92	0.29
107	600600	青岛啤酒	3,024	132,541.92	0.29
108	600096	云天化	26,293	132,516.72	0.29
109	600498	烽火通信	5,325	132,326.25	0.29
110	600026	中远海能	31,002	131,448.48	0.29
111	601718	际华集团	32,531	130,774.62	0.29

112	000726	鲁泰 A	12,100	130,559.00	0.29
113	002589	瑞康医药	9,571	130,548.44	0.29
114	600881	亚泰集团	34,894	130,154.62	0.29
115	600718	东软集团	9,957	130,038.42	0.29
116	600111	北方稀土	11,388	129,595.44	0.29
117	600549	厦门钨业	8,532	129,515.76	0.29
118	600291	西水股份	9,630	128,656.80	0.28
119	000758	中色股份	28,489	128,200.50	0.28
120	002001	新和成	6,670	126,463.20	0.28
121	600597	光明乳业	12,810	126,434.70	0.28
122	000860	顺鑫农业	3,354	125,775.00	0.28
123	000031	中粮地产	21,749	125,709.22	0.28
124	601058	赛轮金宇	51,429	124,972.47	0.28
125	000800	一汽轿车	16,688	124,826.24	0.28
126	000917	电广传媒	21,670	124,819.20	0.28
127	600801	华新水泥	8,300	124,749.00	0.28
128	600277	亿利洁能	23,613	123,732.12	0.27
129	600569	安阳钢铁	31,400	123,716.00	0.27
130	300124	汇川技术	3,767	123,632.94	0.27
131	600859	王府井	5,795	123,259.65	0.27
132	002500	山西证券	18,246	122,978.04	0.27
133	600879	航天电子	17,480	122,884.40	0.27
134	002311	海大集团	5,817	122,738.70	0.27
135	000718	苏宁环球	33,348	122,387.16	0.27
136	300059	东方财富	9,279	122,297.22	0.27
137	600064	南京高科	16,650	122,211.00	0.27
138	600835	上海机电	6,460	121,835.60	0.27
139	600438	通威股份	17,600	121,440.00	0.27
140	600123	兰花科创	17,392	121,222.24	0.27
141	002419	天虹股份	8,247	120,406.20	0.27
142	000729	燕京啤酒	17,854	120,157.42	0.27
143	000937	冀中能源	29,200	120,012.00	0.27
144	000829	天音控股	16,369	119,984.77	0.27
145	600320	振华重工	28,632	119,968.08	0.27
146	600138	中青旅	6,017	119,918.81	0.26
147	600415	小商品城	27,770	119,688.70	0.26
148	600160	巨化股份	16,325	119,499.00	0.26
149	000016	深康佳 A	22,700	119,175.00	0.26
150	000933	神火股份	24,600	118,326.00	0.26

151	002470	金正大	17,160	118,060.80	0.26
152	600240	华业资本	16,096	117,983.68	0.26
153	000012	南玻 A	23,795	117,785.25	0.26
154	600094	大名城	20,394	117,469.44	0.26
155	000559	万向钱潮	17,203	116,980.40	0.26
156	601000	唐山港	49,736	116,879.60	0.26
157	000960	锡业股份	9,721	116,749.21	0.26
158	002221	东华能源	11,892	116,184.84	0.26
159	000685	中山公用	14,550	115,963.50	0.26
160	002385	大北农	28,059	115,883.67	0.26
161	000050	深天马 A	8,130	115,608.60	0.26
162	600978	宜华生活	16,826	114,921.58	0.25
163	600582	天地科技	31,284	114,812.28	0.25
164	000028	国药一致	2,298	114,670.20	0.25
165	002440	闰土股份	9,781	114,339.89	0.25
166	600308	华泰股份	22,800	113,544.00	0.25
167	600067	冠城大通	28,588	113,494.36	0.25
168	600085	同仁堂	3,205	113,072.40	0.25
169	601611	中国核建	14,300	112,970.00	0.25
170	600787	中储股份	14,561	112,702.14	0.25
171	600663	陆家嘴	7,095	112,030.05	0.25
172	000683	远兴能源	39,453	111,651.99	0.25
173	600612	老凤祥	3,100	111,414.00	0.25
174	002129	中环股份	14,200	111,186.00	0.25
175	000501	鄂武商 A	9,038	111,077.02	0.25
176	002416	爱施德	18,747	110,044.89	0.24
177	000951	中国重汽	8,200	108,978.00	0.24
178	600033	福建高速	36,000	108,720.00	0.24
179	002065	东华软件	12,635	108,661.00	0.24
180	000732	泰禾集团	5,558	108,103.10	0.24
181	002048	宁波华翔	8,681	107,036.73	0.24
182	600141	兴发集团	9,155	106,655.75	0.24
183	002128	露天煤业	11,666	105,693.96	0.23
184	600657	信达地产	24,749	105,183.25	0.23
185	000977	浪潮信息	4,400	104,940.00	0.23
186	000999	华润三九	3,744	104,195.52	0.23
187	601678	滨化股份	16,850	104,133.00	0.23
188	600708	光明地产	24,200	104,060.00	0.23
189	600210	紫江企业	30,790	103,762.30	0.23

190	600339	中油工程	23,100	103,719.00	0.23
191	000807	云铝股份	19,771	102,413.78	0.23
192	002309	中利集团	7,156	102,330.80	0.23
193	002701	奥瑞金	18,711	102,162.06	0.23
194	002572	索菲亚	3,161	101,720.98	0.22
195	000418	小天鹅 A	1,464	101,528.40	0.22
196	600686	金龙汽车	8,110	101,293.90	0.22
197	600315	上海家化	2,540	100,660.20	0.22
198	002085	万丰奥威	10,618	99,809.20	0.22
199	600720	祁连山	14,705	99,111.70	0.22
200	603766	隆鑫通用	18,219	98,929.17	0.22
201	000826	启迪桑德	5,643	98,639.64	0.22
202	600388	龙净环保	7,692	98,303.76	0.22
203	002242	九阳股份	5,554	98,250.26	0.22
204	002091	江苏国泰	15,459	98,164.65	0.22
205	600525	长园集团	9,281	98,100.17	0.22
206	002294	信立泰	2,631	97,794.27	0.22
207	000906	浙商中拓	18,994	97,629.16	0.22
208	600761	安徽合力	10,669	96,874.52	0.21
209	601636	旗滨集团	21,736	96,725.20	0.21
210	000400	许继电气	12,370	96,609.70	0.21
211	600939	重庆建工	19,500	96,330.00	0.21
212	600466	蓝光发展	15,498	96,087.60	0.21
213	600017	日照港	29,926	96,062.46	0.21
214	600502	安徽水利	23,890	96,037.80	0.21
215	000921	海信科龙	9,262	95,954.32	0.21
216	600020	中原高速	25,300	95,381.00	0.21
217	600037	歌华有线	9,227	95,222.64	0.21
218	600751	天海投资	14,625	94,916.25	0.21
219	300408	三环集团	4,036	94,846.00	0.21
220	002310	东方园林	6,300	94,689.00	0.21
221	600270	外运发展	4,497	94,257.12	0.21
222	600267	海正药业	6,474	94,131.96	0.21
223	600737	中粮糖业	12,429	93,714.66	0.21
224	601588	北辰实业	26,549	93,452.48	0.21
225	300072	三聚环保	4,009	93,329.52	0.21
226	000887	中鼎股份	6,404	92,281.64	0.20
227	600038	中直股份	2,305	92,176.95	0.20
228	600623	华谊集团	9,205	91,865.90	0.20

229	600120	浙江东方	6,768	91,706.40	0.20
230	601777	力帆股份	17,459	91,310.57	0.20
231	601717	郑煤机	15,698	91,205.38	0.20
232	601928	凤凰传媒	14,957	90,938.56	0.20
233	000006	深振业 A	15,508	90,876.88	0.20
234	002050	三花智控	4,801	90,498.85	0.20
235	601872	招商轮船	25,054	90,444.94	0.20
236	600565	迪马股份	30,508	89,998.60	0.20
237	600073	上海梅林	13,540	89,905.60	0.20
238	000417	合肥百货	15,604	89,723.00	0.20
239	002465	海格通信	11,149	89,526.47	0.20
240	600884	杉杉股份	4,039	89,261.90	0.20
241	601216	君正集团	26,439	89,099.43	0.20
242	002157	正邦科技	21,883	89,063.81	0.20
243	002563	森马服饰	6,200	88,660.00	0.20
244	600511	国药股份	3,284	88,503.80	0.20
245	000598	兴蓉环境	21,719	88,179.14	0.19
246	300058	蓝色光标	15,374	87,631.80	0.19
247	000078	海王生物	18,194	87,513.14	0.19
248	601231	环旭电子	9,588	86,963.16	0.19
249	600373	中文传媒	6,750	86,737.50	0.19
250	002051	中工国际	5,669	86,565.63	0.19
251	600516	方大炭素	3,523	85,890.74	0.19
252	000513	丽珠集团	1,950	85,702.50	0.19
253	600997	开滦股份	16,330	85,569.20	0.19
254	600676	交运股份	17,200	85,484.00	0.19
255	600395	盘江股份	14,070	85,404.90	0.19
256	000717	韶钢松山	13,000	85,280.00	0.19
257	601128	常熟银行	14,900	85,228.00	0.19
258	601866	中远海发	34,045	84,772.05	0.19
259	300027	华谊兄弟	13,724	84,539.84	0.19
260	600216	浙江医药	6,619	84,524.63	0.19
261	000572	海马汽车	24,616	84,432.88	0.19
262	002007	华兰生物	2,625	84,420.00	0.19
263	600959	江苏有线	16,496	84,129.60	0.19
264	600062	华润双鹤	3,426	84,108.30	0.19
265	000089	深圳机场	10,906	83,430.90	0.18
266	601222	林洋能源	16,632	82,827.36	0.18
267	600575	皖江物流	22,300	82,733.00	0.18

268	000536	华映科技	30,082	82,725.50	0.18
269	300017	网宿科技	7,698	82,445.58	0.18
270	000021	深科技	12,083	82,406.06	0.18
271	000789	万年青	7,523	82,301.62	0.18
272	600822	上海物贸	9,500	81,985.00	0.18
273	002249	大洋电机	18,952	81,683.12	0.18
274	600588	用友网络	3,331	81,642.81	0.18
275	002237	恒邦股份	8,941	81,631.33	0.18
276	000627	天茂集团	11,621	81,579.42	0.18
277	002426	胜利精密	22,400	80,640.00	0.18
278	002217	合力泰	9,765	80,561.25	0.18
279	600977	中国电影	5,019	80,504.76	0.18
280	601003	柳钢股份	10,160	80,467.20	0.18
281	002233	塔牌集团	7,026	80,377.44	0.18
282	002152	广电运通	13,626	80,120.88	0.18
283	300433	蓝思科技	3,800	79,724.00	0.18
284	600598	北大荒	8,700	79,692.00	0.18
285	600633	浙数文化	9,516	79,363.44	0.18
286	601966	玲珑轮胎	5,016	79,102.32	0.17
287	601886	江河集团	9,577	78,818.71	0.17
288	002601	龙蟒佰利	6,054	78,278.22	0.17
289	002739	万达电影	1,500	78,060.00	0.17
290	600648	外高桥	4,247	77,635.16	0.17
291	600572	康恩贝	10,791	77,371.47	0.17
292	000902	新洋丰	8,400	77,280.00	0.17
293	002271	东方雨虹	4,522	76,919.22	0.17
294	002375	亚厦股份	14,341	76,580.94	0.17
295	600006	东风汽车	18,578	75,984.02	0.17
296	000877	天山股份	11,243	75,890.25	0.17
297	002191	劲嘉股份	10,088	75,357.36	0.17
298	601311	骆驼股份	6,505	74,612.35	0.16
299	002408	齐翔腾达	6,044	74,220.32	0.16
300	601789	宁波建工	20,477	73,921.97	0.16
301	600743	华远地产	28,700	73,759.00	0.16
302	600894	广日股份	12,377	73,395.61	0.16
303	600909	华安证券	12,757	72,970.04	0.16
304	601880	大连港	37,353	72,464.82	0.16
305	002508	老板电器	2,363	72,355.06	0.16
306	601369	陕鼓动力	11,200	71,680.00	0.16

307	600908	无锡银行	12,100	71,269.00	0.16
308	600803	新奥股份	6,157	71,051.78	0.16
309	002251	步步高	6,243	71,045.34	0.16
310	600491	龙元建设	9,735	68,047.65	0.15
311	002013	中航机电	8,906	67,418.42	0.15
312	000793	华闻传媒	8,000	67,200.00	0.15
313	600295	鄂尔多斯	7,454	67,011.46	0.15
314	601228	广州港	11,500	66,815.00	0.15
315	600580	卧龙电气	8,768	66,812.16	0.15
316	600509	天富能源	14,893	66,571.71	0.15
317	600895	张江高科	5,776	66,424.00	0.15
318	600162	香江控股	26,300	66,276.00	0.15
319	000090	天健集团	10,594	65,682.80	0.15
320	002714	牧原股份	1,461	64,956.06	0.14
321	000030	富奥股份	8,700	64,554.00	0.14
322	603885	吉祥航空	4,164	64,167.24	0.14
323	600809	山西汾酒	1,020	64,147.80	0.14
324	600508	上海能源	6,000	64,080.00	0.14
325	002353	杰瑞股份	3,913	63,586.25	0.14
326	000981	银亿股份	8,400	62,580.00	0.14
327	002267	陕天然气	8,900	62,300.00	0.14
328	002372	伟星新材	3,509	62,074.21	0.14
329	002299	圣农发展	4,000	61,960.00	0.14
330	002203	海亮股份	7,555	61,195.50	0.14
331	600869	智慧能源	12,845	60,628.40	0.13
332	601566	九牧王	4,100	60,475.00	0.13
333	601958	金钼股份	9,636	60,417.72	0.13
334	601101	昊华能源	9,200	59,800.00	0.13
335	600481	双良节能	19,500	59,670.00	0.13
336	002252	上海莱士	3,042	59,379.84	0.13
337	000828	东莞控股	7,252	57,870.96	0.13
338	600231	凌钢股份	16,388	57,849.64	0.13
339	000666	经纬纺机	3,045	55,053.60	0.12
340	000759	中百集团	7,600	54,796.00	0.12
341	601801	皖新传媒	7,196	54,761.56	0.12
342	601021	春秋航空	1,537	53,841.11	0.12
343	002399	海普瑞	2,400	53,136.00	0.12
344	002482	广田集团	8,896	53,109.12	0.12
345	600566	济川药业	1,072	51,659.68	0.11

346	600428	中远海特	14,508	51,503.40	0.11
347	002429	兆驰股份	20,420	50,641.60	0.11
348	000761	本钢板材	12,500	50,500.00	0.11
349	600278	东方创业	6,377	50,314.53	0.11
350	000587	金洲慈航	9,830	48,756.80	0.11
351	000938	紫光股份	765	47,889.00	0.11
352	000869	张裕 A	1,200	47,832.00	0.11
353	601139	深圳燃气	8,580	47,619.00	0.11
354	600180	瑞茂通	4,900	47,481.00	0.10
355	601163	三角轮胎	3,542	47,321.12	0.10
356	600682	南京新百	2,873	47,232.12	0.10
357	000429	粤高速 A	6,500	46,930.00	0.10
358	002662	京威股份	11,098	46,611.60	0.10
359	600372	中航电子	3,550	46,363.00	0.10
360	002032	苏泊尔	900	46,350.00	0.10
361	000980	众泰汽车	6,400	45,504.00	0.10
362	002080	中材科技	5,351	45,483.50	0.10
363	600754	锦江股份	1,216	44,943.36	0.10
364	000631	顺发恒业	13,000	44,590.00	0.10
365	000596	古井贡酒	499	44,301.22	0.10
366	603198	迎驾贡酒	2,408	44,234.96	0.10
367	002344	海宁皮城	8,985	43,667.10	0.10
368	603328	依顿电子	3,900	42,315.00	0.09
369	600012	皖通高速	6,900	41,124.00	0.09
370	000582	北部湾港	5,344	40,454.08	0.09
371	002302	西部建设	3,700	39,849.00	0.09
372	600126	杭钢股份	6,565	39,193.05	0.09
373	600390	五矿资本	4,900	37,975.00	0.08
374	601828	美凯龙	2,400	36,672.00	0.08
375	000537	广宇发展	3,800	36,632.00	0.08
376	000553	沙隆达 A	2,300	36,363.00	0.08
377	601127	小康股份	1,960	33,888.40	0.07
378	000990	诚志股份	2,380	33,320.00	0.07
379	601838	成都银行	3,800	33,250.00	0.07
380	603225	新凤鸣	1,300	25,961.00	0.06
381	601108	财通证券	2,300	25,944.00	0.06
382	603806	福斯特	1,149	25,289.49	0.06
383	600346	恒力股份	1,700	24,922.00	0.06
384	601326	秦港股份	5,500	22,330.00	0.05

385	600828	茂业商业	4,200	21,420.00	0.05
386	000987	越秀金控	2,561	20,129.46	0.04
387	600233	圆通速递	1,466	19,351.20	0.04
388	601019	山东出版	2,200	17,622.00	0.04
389	603056	德邦股份	600	16,434.00	0.04
390	601878	浙商证券	1,900	15,960.00	0.04
391	002010	传化智联	1,300	15,795.00	0.03
392	601360	三六零	300	8,670.00	0.02

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

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	占基金资产净值比例（%）
1	601118	海南橡胶	14,729	97,505.98	0.22
2	000939	凯迪生态	14,449	72,100.51	0.16
3	000603	盛达矿业	5,794	62,749.02	0.14
4	600485	信威集团	4,100	59,819.00	0.13
5	000022	深赤湾 A	1,876	42,810.32	0.09
6	000156	华数传媒	4,216	40,642.24	0.09
7	002075	沙钢股份	2,420	39,010.40	0.09

注：积极投资股票为被动持有非当前成分股，将逐步进行调整成分股。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000878	云南铜业	281,059.00	0.50
2	600875	东方电气	267,537.00	0.47
3	000059	华锦股份	266,340.00	0.47
4	000425	徐工机械	256,445.00	0.45
5	600266	北京城建	247,968.00	0.44
6	600489	中金黄金	216,580.00	0.38
7	600348	阳泉煤业	215,156.00	0.38
8	000703	恒逸石化	214,254.00	0.38
9	600694	大商股份	201,203.00	0.35

10	600649	城投控股	188,375.00	0.33
11	600157	永泰能源	186,660.00	0.33
12	601699	潞安环能	181,608.00	0.32
13	000600	建投能源	169,675.00	0.30
14	601179	中国西电	169,454.00	0.30
15	000550	江铃汽车	167,403.00	0.29
16	300226	上海钢联	160,767.00	0.28
17	000792	盐湖股份	150,060.00	0.26
18	600269	赣粤高速	146,395.00	0.26
19	000413	东旭光电	143,280.00	0.25
20	603858	步长制药	140,532.00	0.25

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000830	鲁西化工	433,585.47	0.76
2	600596	新安股份	297,668.00	0.52
3	600703	三安光电	275,922.77	0.49
4	600705	中航资本	254,299.26	0.45
5	600406	国电南瑞	242,455.58	0.43
6	002422	科伦药业	222,080.00	0.39
7	600276	恒瑞医药	220,248.47	0.39
8	600315	上海家化	214,237.80	0.38
9	601233	桐昆股份	211,002.00	0.37
10	600867	通化东宝	182,591.86	0.32
11	002230	科大讯飞	173,140.71	0.30
12	600782	新钢股份	167,993.40	0.30
13	600369	西南证券	164,798.79	0.29
14	300003	乐普医疗	161,041.36	0.28
15	000690	宝新能源	158,769.30	0.28
16	600729	重庆百货	157,825.20	0.28
17	600004	白云机场	144,119.00	0.25
18	002027	分众传媒	143,796.18	0.25

19	603993	洛阳钼业	143,341.70	0.25
20	000860	顺鑫农业	137,523.00	0.24

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	12,467,661.74
卖出股票收入（成交）总额	14,204,044.73

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

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2

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	205.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	792.24
5	应收申购款	1,992.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,990.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601118	海南橡胶	97,505.98	0.22	重大事项
2	000939	凯迪生态	72,100.51	0.16	重大事项
3	000603	盛达矿业	62,749.02	0.14	重大事项
4	600485	信威集团	59,819.00	0.13	重大事项
5	000022	深赤湾 A	42,810.32	0.09	重大事项

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)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰信基本面 400A	54	14,127.61	27,899.00	3.66%	734,992.00	96.34%
泰信基本面 400B	401	1,902.47	108.00	0.01%	762,783.00	99.99%
泰信基本面 400	542	80,992.65	34,045,462.72	77.56%	9,852,552.35	22.44%
合计	997	45,560.48	34,073,469.72	75.01%	11,350,327.35	24.99%

8.2 期末上市基金前十名持有人

jiJinJianChengA1

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	傅喜元	451,503.00	59.18%
2	邵海波	96,359.00	12.63%
3	蓝晓	58,461.00	7.66%
4	黄晖	48,119.00	6.31%
5	华夏未来资本管理有限公司－华夏未来添时 1 号基金	27,899.00	3.66%
6	方春娣	21,566.00	2.83%
7	许春帆	10,783.00	1.41%
8	莫春风	9,703.00	1.27%
9	张晓波	8,400.00	1.10%
10	董忠义	5,391.00	0.71%

jiJinJianChengB1

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	韩莉颍	111,281.00	14.59%
2	蓝晓	38,106.00	4.99%
3	吉庆伍	26,086.00	3.42%

4	崔文涛	22,428.00	2.94%
5	王方	19,539.00	2.56%
6	孙丽君	16,713.00	2.19%
7	包素芹	15,700.00	2.06%
8	张敏红	15,484.00	2.03%
9	黄超浩	13,975.00	1.83%
10	陈锦峰	13,134.00	1.72%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
基金合同生效日（2012 年 9 月 7 日）基金份额总额	-	-	300,843,720.90
本报告期期初基金份额总额	3,736,353.00	3,736,353.00	67,828,585.40
本报告期基金总申购份额	-	-	1,077,019.51
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	4,279,768.46
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-2,973,462.00	-2,973,462.00	-20,727,821.38
本报告期期末基金份额总额	762,891.00	762,891.00	43,898,015.07

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
川财证券	1	14,857,446.88	55.82%	13,837.00	56.36%	-

中国银河证券	1	11,757,654.69	44.18%	10,714.90	43.64%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
川财证券	-	-	-	-	-	-

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

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	办理定期份额折算期间泰信 400A 份额停复牌公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 3 日
2	第七个运作周期约定收益率公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 3 日
3	新增盈米财富为销售机构并开通转换定投及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 4 日
4	定期折算结果及恢复交易公告、泰信 400A 前收盘价调整公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018 年 1 月 4 日

		及公司网站（www.ftfund.com）	
5	停牌股票估值调整（冀东水泥）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年1月9日
6	在嘉实基金开通费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年1月19日
7	17年4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年1月19日
8	在大泰金石、中泰证券开通申购、定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年1月30日
9	新增上海基煜基金为销售机构并开通转换、定投及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年1月31日
10	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年2月7日
11	B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年2月7日
12	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年2月8日
13	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年2月9日
14	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年2月10日
15	B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018年2月13日

		及公司网站（www.ftfund.com）	
16	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年2月14日
17	B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年2月22日
18	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年2月24日
19	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年2月27日
20	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年2月28日
21	17年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年3月29日
22	东海证券、工商银行费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年3月30日
23	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年3月30日
24	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月4日
25	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月9日
26	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018年4月10日

	告	及公司网站（www.ftfund.com）	
27	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月13日
28	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月14日
29	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月17日
30	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月18日
31	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月19日
32	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月21日
33	2018年1季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月21日
34	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月24日
35	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月25日
36	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月26日
37	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018年4月27日

	告	及公司网站（www.ftfund.com）	
38	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年4月28日
39	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月3日
40	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月4日
41	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月5日
42	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月8日
43	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月9日
44	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月10日
45	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月11日
46	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月12日
47	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月15日
48	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018年5月16日

		及公司网站（www.ftfund.com）	
49	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月17日
50	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月18日
51	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月19日
52	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月24日
53	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月25日
54	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月26日
55	新增济安财富（北京）基金为销售机构并开通转换定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月26日
56	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月29日
57	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月30日
58	参加银河证券申购定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月30日
59	新增天津国美基金销售有限公司为销售机构并开通转换及费率优	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018年5月30日

	惠业务	及公司网站（www.ftfund.com）	
60	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年5月31日
61	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月1日
62	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月2日
63	可能发生不定期折算业务公告、B类份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月5日
64	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月6日
65	参加华宝证券费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月6日
66	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月7日
67	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月8日
68	可能发生不定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月9日
69	在国金证券开通转换定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月13日
70	旗下基金终止懒猫金服销售业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018年6月20日

		及公司网站（www.ftfund.com）	
71	不定期折算公告（下折）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月20日
72	不定期折算B类份额风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月20日
73	不定期折算折算基准日B类份额证券简称调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月20日
74	400B 份额交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月21日
75	不定期折算期间泰信 400A、泰信400B停复牌公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月21日
76	不定期份额折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月22日
77	不定期折算后复牌首日泰信400A、泰信400B前收盘价调整公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018年6月22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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	29,104,230.83	981,431.85	11,450,906.85	18,634,755.83	41.02%
	2	20180101-20180630	24,010,861.29	809,676.94	9,446,947.34	15,373,590.89	33.84%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金设立的文件

2、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》

3、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金招募说明书》

4、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级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、基金托管人的办公场所，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

2018 年 8 月 25 日