

# 泰信行业精选灵活配置混合型 证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 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。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期为 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	17
4.10 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.....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 净资产变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	57

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
8.6 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.....	72
8.7 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.....	72
8.8 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.....	72
8.9 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.....	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	72
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>73</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
9.3 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.....	74
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>74</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>74</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	74
11.2 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.....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
11.4 基金投资策略的改变.....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	75
11.8 其他重大事件.....	76
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>80</b>
12.1 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.....	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>81</b>
13.1 备查文件目录.....	81
13.2 存放地点.....	81
13.3 查阅方式.....	81

## § 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	711,878,486.62 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	524,170,682.60 份	187,707,804.02 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会，在控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。
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	姜敏
	联系电话	021-20899003	4006800000
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		400-888-5988	95558
传真		021-20899008	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1

	东南路 256 号 36-37 层	号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200120	100020
法定代表人	李高峰	方合英

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年		2022 年		2021 年	
	泰信行业精选混合 A	泰信行业精选混合 C	泰信行业精选混合 A	泰信行业精选混合 C	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	53,434,739.06	17,170,365.61	222,654.86	154,896.27	1,919,580.97	-
本期利润	-167,357.43	-23,928,879.01	1,908,216.89	685,388.22	-6,179,468.18	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0007	-0.3711	0.0334	0.2394	-0.1415	-
本期加权平均净值利润率	-0.04%	-18.74%	2.35%	16.28%	-9.24%	-
本期	35.20%	34.93%	6.19%	6.19%	-9.53%	-9.53%

基金份额净值增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	220,674,375.30	78,464,625.09	33,675,626.82	6,717,065.93	20,533,650.12	-
期末可供分配基金份额利润	0.4210	0.4180	0.4668	0.4662	0.4641	0.0000
期末基金资产净值	957,923,042.48	342,431,945.01	116,387,295.77	23,237,892.91	67,199,766.75	0.00
期末基金份额净值	1.828	1.824	1.613	1.613	1.519	1.519
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	145.70%	119.71%	81.74%	62.83%	71.15%	53.35%

注：1、本基金合同自 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
过去三个月	5.08%	1.98%	-3.53%	0.43%	8.61%	1.55%
过去六个月	0.79%	1.77%	-5.25%	0.47%	6.04%	1.30%
过去一年	35.20%	1.99%	-4.64%	0.46%	39.84%	1.53%
过去三年	29.88%	1.75%	-15.39%	0.61%	45.27%	1.14%
过去五年	138.33%	1.81%	19.86%	0.67%	118.47%	1.14%
自基金合同生效起至今	145.70%	1.53%	20.91%	0.76%	124.79%	0.77%

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
过去三个月	4.98%	1.98%	-3.53%	0.43%	8.51%	1.55%
过去六个月	0.68%	1.76%	-5.25%	0.47%	5.93%	1.29%
过去一年	34.93%	1.99%	-4.64%	0.46%	39.57%	1.53%
过去三年	29.63%	1.75%	-15.39%	0.61%	45.02%	1.14%
过去五年	137.86%	1.81%	19.86%	0.67%	118.00%	1.14%
自基金合同生效起至今	119.71%	1.64%	20.96%	0.63%	98.75%	1.01%

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。

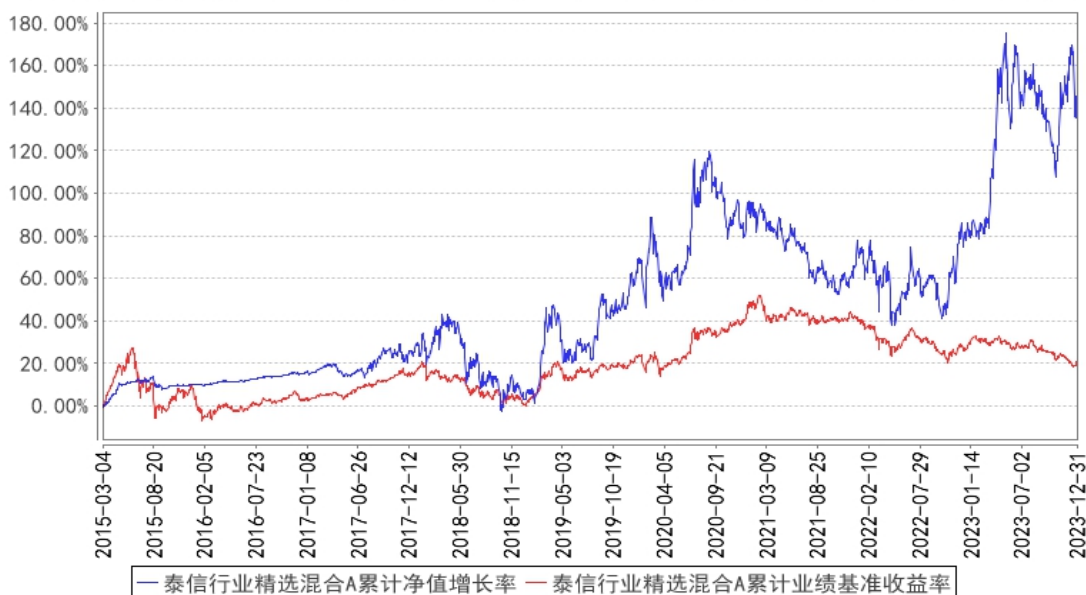
1、沪深 300 指数由中国 A 股各行业上市公司中最具流动性的 300 家公司编制而成，能够全面反映股票市场的波动，是股票市场中风险收益特征较好的指数之一。



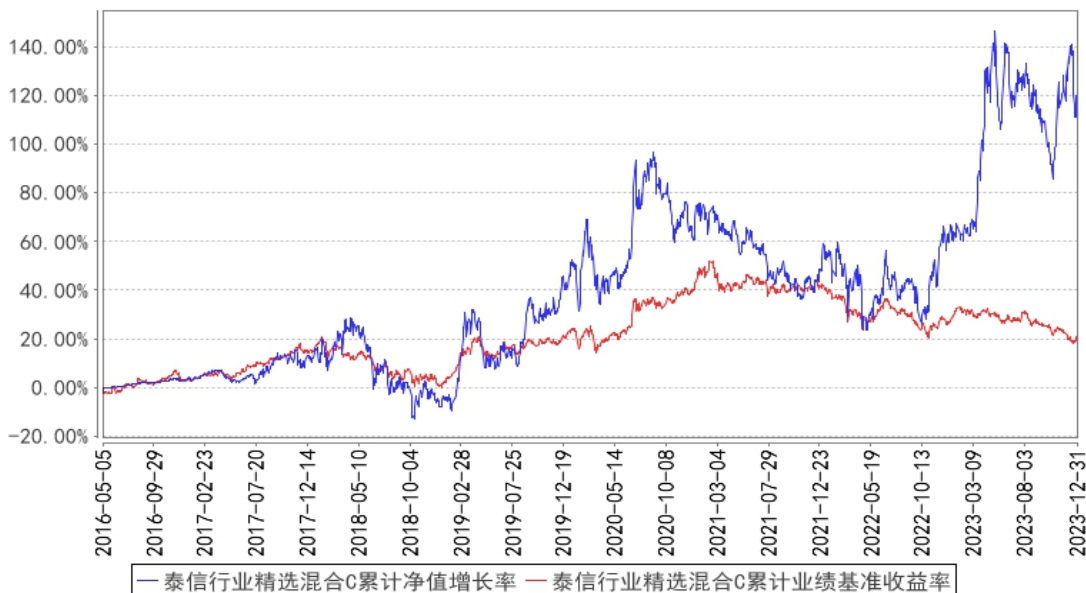
2、上证国债指数样本涵盖了上海证券交易所所有的国债品种，交易所的国债交易市场具有参与主体丰富、竞价交易连续的特性，能反映出市场利率的瞬息变化，也使得上证国债指数能真实地標示出利率市场整体的收益风险度。

### 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

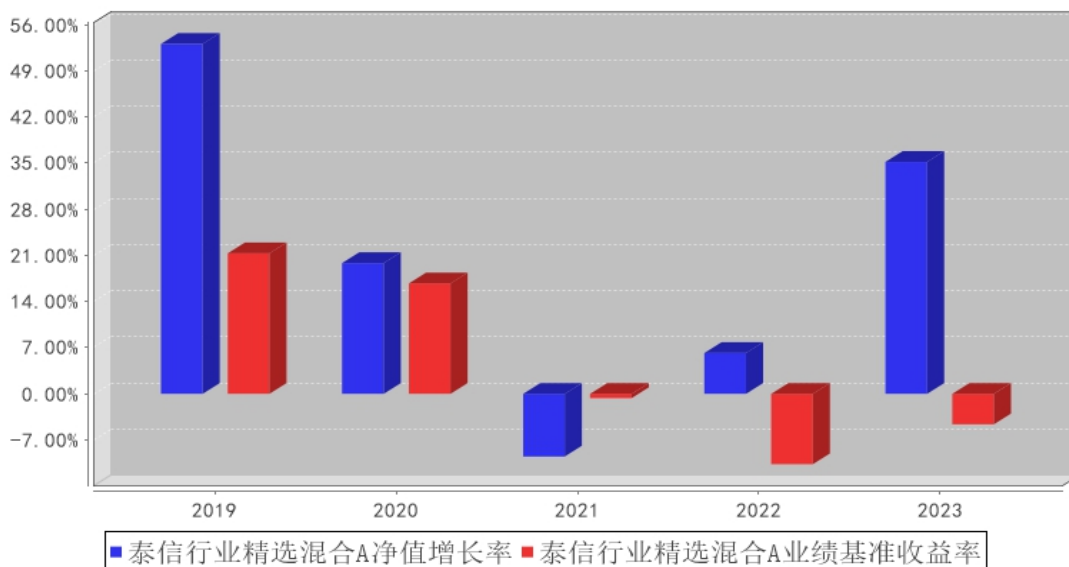


泰信行业精选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

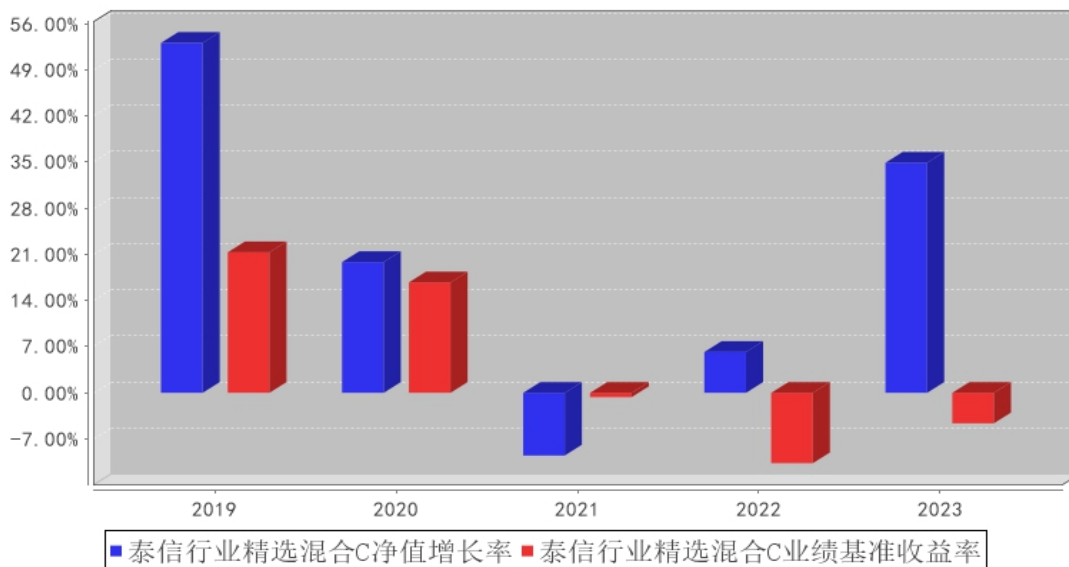


## 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰信行业精选混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



泰信行业精选混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

泰信行业精选混合 A

年度	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	年度利润分配合计	备注
2023 年	3.500	110,225,846.64	12,051,700.10	122,277,546.74	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	3.500	110,225,846.64	12,051,700.10	122,277,546.74	-

泰信行业精选混合 C

年度	每 10 份基金	现金形式发放总额	再投资形式发	年度利润分配	备注
----	----------	----------	--------	--------	----

	份额分红数		放总额	合计	
2023 年	3.500	26,828,981.88	7,488,897.41	34,317,879.29	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	3.500	26,828,981.88	7,488,897.41	34,317,879.29	-

## § 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：李高峰代任

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。

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、董监事工作部（党群工作部）、综合管理部。截至 2023 年 12 月末，公司有正式员工 118 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 12 月末，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、泰信竞争优选混合、泰信景气驱动12个月持有期混合、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、泰信优势领航混合、泰信汇鑫三个月定开债券、泰信添鑫中短债债券、泰信添益90天持有期债券共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	-	19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 公平交易制度和控制方法

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《泰信基金管理有限公司公平交易管理办法》以及《泰信基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，主要控制方法如下：

- 1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。
- 2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。
- 3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。
- 4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

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。

5、集中交易部负责所有投资指令的执行，必须确保所有同向指令的公平公正，平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令，集中交易部应立即停止执行指令，并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令，不同投资组合也必须公平对待，主要采取成交结果按比例分配和轮候方式处理。

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的内日反向交易，严格控制不同投资组合之间的内日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的内日反向交易。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数，强制交易系统对符合要求的同一交易品种的内向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析，对强制公平委托的执行过程与结果进行检查；对不同投资组合临近交易日的内向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，并完成定期分析报告。

#### 4.3.2 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部集中执行，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，根据投资交易监控与价差分析情况，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。

#### 4.3.3 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内日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的内日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价内日反向交易，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。

### 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下跌，创业板指下跌近 20%，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。

虽然房地产和城投债的问题没有完全解决，但是随着国内经济的稳增长措施加码落地实施，市场对中国经济的结构性问题也有了充分认知，投资者信心逐步恢复。市场出现了一些新产业趋势，比如智能驾驶、华为链、苹果 MR 和人工智能等。其中人工智能板块发展趋势尤为明显，2023 年上半年主要是大模型在文生文和文生图领域实现商用，最近实现了文生动画视频模型的商用。市场等待产业界推出新的 AI 应用，后续可能出现文生真人视频的模型商用。本基金配置了影视、

元宇宙、AIGC、游戏、机器人、广电、营销、医药和国外旅游等板块，在几次高点兑现了部分高估的品种，取得了一定收益，全年分红 5 次，及时回报了持有人。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信行业精选混合 A 基金份额净值为 1.828 元，本报告期基金份额净值增长率为 35.20%；截止本报告期末泰信行业精选混合 C 基金份额净值为 1.824 元，本报告期基金份额净值增长率为 34.93%；同期业绩比较基准收益率为-4.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理层不断修复市场的悲观预期，美联储加息预期出现转折，市场预期美联储加息结束交易，但是通胀仍有可能超预期。后续 A 股反弹延续的一个重要条件，是“稳汇率”有效，人民币汇率稳中有升。

当前市场对中国经济的结构性问题(典型是房地产和化债)有充分认知，所以对刺激政策期待很高，对做多 A 股顺周期资产预设的必要条件也高。但与此同时，市场需要等待具体政策执行和效果验证。若中美贸易摩擦阶段性缓和，人民币汇率压力缓和，内外需预期都将改善，可能成为助力 A 股打破震荡格局的关键变化。后续出口数据验证情况值得重点跟踪，中特估概念会有各种事件催化。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。国际方面继续观察是否有关键性事件出现。

相对于当前的市场利率，股市估值水平合理，A 股可能出现了十年一遇的重要投资机会。我们期待在国企、土地、财税等方面继续推出重大力度改革，股市走上长牛之路。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人合规管理及内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。

##### 1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规，及时补充及完善了内部管理制度，同时对业务流程进一步梳理，严格按照监管要求进行风险控制评估及合规管理有效性评估，确保风险控制及合规管理的有效性，不断提升内部控制水平。

##### 2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制

(1) 加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议、政策法规规定对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指

标进行测试和更新。

(2) 规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易，对基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标进行预警监控。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

### 3、加强内部的监察稽核

针对基金投资运作通过日常监察与专项稽核相结合，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，通过查漏补缺、及时整改强化了风险控制流程，提高了投资管理及运营相关人员的风险意识水平，从而较好地预防风险，维护基金持有人利益。

### 4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识

公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

在本报告期内，本基金的投资运作各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

## 4.7 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。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

### 一、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 类份额每 10 份分配 3.500 元，利润分配合计 122,277,546.74 元（其中，现金形式发放 110,225,846.64 元，再投资形式发放 12,051,700.10 元）；本基金 C 类份额每 10 份分配 3.500 元，利润分配合计 34,317,879.29 元（其中，现金形式发放 26,828,981.88 元，再投资形式发放 7,488,897.41 元）。符合基金合同的约定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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 年度报告中的财务指标、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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(24)第 P00019 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金全体持有人：
审计意见	我们审计了泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	泰信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不

	<p>对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露</p>

	<p>不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	胡小骏	谭麟林
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	67,560,377.74	13,533,457.01
结算备付金		1,952,714.93	86,456.35
存出保证金		304,673.99	19,851.34
交易性金融资产	7.4.7.2	1,224,237,476.42	128,533,021.25
其中：股票投资		1,224,237,476.42	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		196,617.75	-
应收股利		-	-

应收申购款		17,190,236.72	1,152,423.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,311,442,097.55	143,325,209.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	416,233.72
应付赎回款		8,662,855.16	2,935,846.03
应付管理人报酬		1,327,786.18	119,792.00
应付托管费		221,297.67	24,956.68
应付销售服务费		28,642.62	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	7.4.7.6	819,394.03	174,666.48
负债合计		11,087,110.06	3,700,021.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	711,878,486.62	86,544,989.03
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	588,476,500.87	53,080,199.65
净资产合计		1,300,354,987.49	139,625,188.68
负债和净资产总计		1,311,442,097.55	143,325,209.92

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 711,878,486.62 份。其中：泰信行业精选混合 A 份额净值人民币 1.828 元，基金份额总额 524,170,682.60 份；泰信行业精选混合 C 份额净值人民币 1.824 元，基金份额总额 187,707,804.02 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-15,712,715.35	3,981,796.38
1. 利息收入		368,562.66	51,823.53
其中：存款利息收入	7.4.7.9	334,723.33	50,422.03

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		33,839.33	1,401.50
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		69,225,312.13	632,251.10
其中：股票投资收益	7.4.7.10	67,773,526.32	229,836.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,451,785.81	402,414.42
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）	7.4.7.16	-94,701,341.11	2,216,053.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	9,394,750.97	1,081,667.77
<b>减：二、营业总支出</b>		8,383,521.09	1,388,191.27
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,800,102.41	1,016,397.17
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,234,821.37	211,749.46
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	124,819.93	3,789.47
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	223,777.38	156,255.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-24,096,236.44	2,593,605.11
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-24,096,236.44	2,593,605.11
<b>五、其他综合收益的税后</b>		-	-

净额			
六、综合收益总额		-24,096,236.44	2,593,605.11

### 7.3 净资产变动表

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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	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	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）	625,333,497.59	-	535,396,301.22	1,160,729,798.81
（一）、综合收益总额	-	-	-24,096,236.44	-24,096,236.44
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	625,333,497.59	-	716,087,963.69	1,341,421,461.28
其中：1. 基金申购款	1,499,882,480.97	-	1,596,274,785.46	3,096,157,266.43
2. 基金赎回款	-874,548,983.38	-	-880,186,821.77	-1,754,735,805.15
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-156,595,426.03	-156,595,426.03
（四）、其他综合收益结转留存收	-	-	-	-

益				
四、本期期末净资产	711,878,486.62	-	588,476,500.87	1,300,354,987.49
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31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	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	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)	42,299,466.32	-	30,125,955.61	72,425,421.93
(一)、综合收益总额	-	-	2,593,605.11	2,593,605.11
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	42,299,466.32	-	27,532,350.50	69,831,816.82
其中：1. 基金申购款	178,122,583.30	-	87,681,937.23	265,804,520.53
2. 基金赎回款	-135,823,116.98	-	-60,149,586.73	-195,972,703.71
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	86,544,989.03	-	53,080,199.65	139,625,188.68

报表附注为财务报表的组成部分。



本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

李高峰	叶振宇	顾颖
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金

融资产计入“交易性金融资产”。

## 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### 2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计

利息(若有)后的差额,确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认,由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

### 3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

### 4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

## 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

## 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566号)所规定的固定收益品种，本基金根据该标准的相关规定进行估值、减值计量。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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、债券免征增值税; 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; 自2023年8月28日起, 出让方减按0.05%的税率缴纳证券(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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	67,560,377.74	13,533,457.01
等于：本金	67,543,317.01	13,530,306.17



加：应计利息	17,060.73	3,150.84
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	67,560,377.74	13,533,457.01

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,315,302,455.34	-	1,224,237,476.42	-91,064,978.92
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	1,315,302,455.34	-	1,224,237,476.42	-91,064,978.92
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	124,896,659.06	-	128,533,021.25	3,636,362.19
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		124,896,659.06	-	128,533,021.25	3,636,362.19

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,490.40	309.11
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	640,103.63	58,157.37
其中：交易所市场	640,103.63	58,157.37
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	177,800.00	116,200.00
合计	819,394.03	174,666.48

#### 7.4.7.7 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12月31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	990,139,755.27	990,139,755.27
本期赎回（以“-”号填列）	-538,104,652.85	-538,104,652.85
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	524,170,682.60	524,170,682.60

##### 泰信行业精选混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	509,742,725.70	509,742,725.70
本期赎回（以“-”号填列）	-336,444,330.53	-336,444,330.53
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	187,707,804.02	187,707,804.02

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。

#### 7.4.7.8 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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	33,675,626.82	10,576,088.77	44,251,715.59
本期利润	53,434,739.06	-53,602,096.49	-167,357.43
本期基金份额交易产生的变动数	255,841,556.16	256,103,992.30	511,945,548.46
其中：基金申购款	551,940,968.27	503,250,135.61	1,055,191,103.88
基金赎回款	-296,099,412.11	-247,146,143.31	-543,245,555.42
本期已分配利润	-122,277,546.74	-	-122,277,546.74
本期末	220,674,375.30	213,077,984.58	433,752,359.88

##### 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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,717,065.93	2,111,418.13	8,828,484.06
本期利润	17,170,365.61	-41,099,244.62	-23,928,879.01
本期基金份额交易产生的变动数	88,895,072.84	115,247,342.39	204,142,415.23
其中：基金申购款	266,141,173.59	274,942,507.99	541,083,681.58
基金赎回款	-177,246,100.75	-159,695,165.60	-336,941,266.35
本期已分配利润	-34,317,879.29	-	-34,317,879.29
本期末	78,464,625.09	76,259,515.90	154,724,140.99

#### 7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	315,389.17	48,776.72
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	16,643.29	1,276.55
其他	2,690.87	368.76
合计	334,723.33	50,422.03

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	67,773,526.32	229,836.68
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	67,773,526.32	229,836.68

##### 7.4.7.10.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	584,209,782.10	57,897,310.06
减：卖出股票成本总额	513,871,553.08	57,430,658.30
减：交易费用	2,564,702.70	236,815.08
买卖股票差价收入	67,773,526.32	229,836.68

#### 7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

**7.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,451,785.81	402,414.42
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	1,451,785.81	402,414.42

**7.4.7.16 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-94,701,341.11	2,216,053.98
股票投资	-94,701,341.11	2,216,053.98
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	-94,701,341.11	2,216,053.98

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月	上年度可比期间 2022年1月1日至2022
----	--------------------------	---------------------------

	31 日	年 12 月 31 日
基金赎回费收入	9,304,976.33	1,049,522.31
基金转换费收入	89,774.64	32,145.46
合计	9,394,750.97	1,081,667.77

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。

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	57,800.00	36,200.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	8,777.38	2,655.17
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,400.00
合计	223,777.38	156,255.17

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

2024 年 3 月 18 日，本基金管理人发布《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金分红公告》，收益分配基准日为 2024 年 3 月 11 日，权益登记日、除息日为 2024 年 3 月 19 日，红利发放日为 2024 年 3 月 20 日，本基金 A 类基金份额收益分配分案为每 10 份基金份额派发红利人民币 0.860 元，C 类基金份额收益分配分案为每 10 份基金份额派发红利人民币 0.860 元。

除以上情况外，截至财务报表批准报出日，本基金无其他需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,800,102.41	1,016,397.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,653,690.30	434,667.98
应支付基金管理人的净管理费	4,146,412.11	581,729.19

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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,234,821.37	211,749.46

注：1、支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

2、根据《泰信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修订基金合同等事项的公告》，自 2023 年 8 月 14 日起，本基金托管费率由 0.25% 变更为 0.20%。

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	-	4,002.35	4,002.35
中信银行	-	0.15	0.15
合计	-	4,002.50	4,002.50
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 12 月 31 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	-	0.04	0.04
中信银行	-	-	-
合计	-	0.04	0.04

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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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。



#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金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。

##### 7.4.10.5.2 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

本基金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。

#### 7.4.10.6 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12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	67,560,377.74	315,389.17	13,533,457.01	48,776.72

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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 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	-
2	2023年8月31日	-	2023年8月31日	1.000	32,721,540.44	2,630,713.68	35,352,254.12	-
3	2023年9月27日	-	2023年9月27日	0.900	29,349,408.31	3,046,249.86	32,395,658.17	-
4	2023年11月22日	-	2023年11月22日	0.470	17,606,731.02	2,175,633.02	19,782,364.04	-
5	2023年12月21日	-	2023年12月21日	0.430	19,710,596.23	3,157,495.23	22,868,091.46	-
合计				3.500	110,225,846.64	12,051,700.10	122,277,546.74	-
泰信行业精选混合 C								
序	权益	除息日		每 10 份基	现金形	再投资形	本期利	备注

号	登记日	场内	场外	金份额分 红数	式 发放总 额	式 发放总额	润分配 合计	
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	-
2	2023年8月31日	-	2023年8月31日	1.000	7,277,726.43	1,513,818.23	8,791,544.66	-
3	2023年9月27日	-	2023年9月27日	0.900	5,943,733.29	1,795,193.23	7,738,926.52	-
4	2023年11月22日	-	2023年11月22日	0.470	4,033,989.43	1,330,925.99	5,364,915.42	-
5	2023年12月21日	-	2023年12月21日	0.430	6,378,757.21	2,225,418.17	8,604,175.38	-
合计				3.500	26,828,981.88	7,488,897.41	34,317,879.29	-

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-

301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	282	15,701.76	10,597.56	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月	新股流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	204	13,806.72	12,111.48	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-

301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	47.58	30.22	517	24,598.86	15,623.74	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	333	19,200.78	15,734.25	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	428	17,115.72	16,610.68	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞	2023	6个月	新股	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-

	南资源	年9月 13日		流通 受限							
301505	苏州规划	2023 年7月 12日	6个月	新股 流通 受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-	
301507	民生健康	2023 年8月 24日	6个月	新股 流通 受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-	
301508	中机认检	2023 年11 月23 日	6个月	新股 流通 受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-	
301509	金凯生科	2023 年7月 26日	6个月	新股 流通 受限	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-	
301510	固高科技	2023 年8月 4日	6个月	新股 流通 受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-	
301511	德福科技	2023 年8月 8日	6个月	新股 流通 受限	28.00	22.67	818	22,904.00	18,544.06	-	
301516	中远通	2023 年12 月1日	6个月	新股 流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-	
301517	陕西华达	2023 年10 月9日	6个月	新股 流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-	
301518	长华化学	2023 年7月 26日	6个月	新股 流通 受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-	
301519	舜禹股份	2023 年7月 19日	6个月	新股 流通 受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-	
301520	万邦	2023 年9月	6个月	新股 流通	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-	

	医药	18 日		受限							
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	6 个月	新股流通受限	99.57	81.46	202	20,113.14	16,454.92	-	
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-	
301528	多浦乐	2023 年 8 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-	
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	6 个月	新股流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-	
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-	
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-	
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股流通受限	24.22	18.24	1,033	25,019.26	18,841.92	-	
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	22.14	709	6,310.10	15,697.26	-	
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-	

		日								
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-

	份									
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	2,191	21,625.17	27,935.25	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	366	28,910.34	22,139.34	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	525	14,038.50	20,301.75	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股流通受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	275	13,004.75	10,441.75	-
688627	精	2023	6个月	新股	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-



	智达	年7月 11日		流通 受限						
688646	逸飞激光	2023 年7月 21日	6个月	新股 流通 受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023 年11 月6日	6个月	新股 流通 受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023 年7月 19日	6个月	新股 流通 受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023 年11 月22 日	6个月	新股 流通 受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023 年11 月10 日	6个月	新股 流通 受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023 年9月 25日	6个月	新股 流通 受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023 年8月 2日	6个月	新股 流通 受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023 年8月 10日	6个月	新股 流通 受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023 年9月 6日	6个月	新股 流通 受限	42.66	48.18	494	21,074.04	23,800.92	-
688716	中研股份	2023 年9月 13日	6个月	新股 流通 受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛	2023 年9月 20日	6个月	新股 流通 受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-

	博									
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

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。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 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。

#### 7.4.12.4 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。

### 7.4.13 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。

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的货币资金存放于本基金的基金托管人中信银行，与该货币资金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 12 月 31 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）。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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 7.4.12 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公司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 12 月 31 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 0.0792%。

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 12 月 31 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 1,299,475,242.75 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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货币资金、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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	67,560,377.74	-	-	-	67,560,377.74
结算备付金	1,952,714.93	-	-	-	1,952,714.93
存出保证金	304,673.99	-	-	-	304,673.99
交易性金融资产	-	-	-	-1,224,237,476.42	1,224,237,476.42
应收申购款	-	-	-	17,190,236.72	17,190,236.72
应收清算款	-	-	-	196,617.75	196,617.75
资产总计	69,817,766.66	-	-	-1,241,624,330.89	1,311,442,097.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,662,855.16	8,662,855.16
应付管理人报酬	-	-	-	1,327,786.18	1,327,786.18
应付托管费	-	-	-	221,297.67	221,297.67
应付销售服务费	-	-	-	28,642.62	28,642.62
应交税费	-	-	-	27,134.40	27,134.40
其他负债	-	-	-	819,394.03	819,394.03
负债总计	-	-	-	11,087,110.06	11,087,110.06
利率敏感度缺口	69,817,766.66	-	-	-1,230,537,220.83	1,300,354,987.49
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					
货币资金	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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	1,224,237,476.42	94.15	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	1,224,237,476.42	94.15	128,533,021.25	92.06

##### 7.4.13.4.2.2 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		
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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	92,456,209.29	7,329,916.40
	2. 业绩比较基准下降 5%	-92,456,209.29	-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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,223,207,926.43	128,416,996.25
第二层次	-	116,025.00
第三层次	1,029,549.99	-
合计	1,224,237,476.42	128,533,021.25

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,235,383.16	1,235,383.16
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	402,824.37	402,824.37
当期利得或损失总额	-	196,991.20	196,991.20
其中：计入损益的利得或损失	-	196,991.20	196,991.20

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,029,549.99	1,029,549.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	167,052.99	167,052.99
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,682,426.97	1,682,426.97
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,674,546.75	1,674,546.75
当期利得或损失总额	-	-7,880.22	-7,880.22
其中：计入损益的利得或损失	-	-7,880.22	-7,880.22
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,029,549.99	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1462-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-



#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 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 and 账面价值相若。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	1,224,237,476.42	93.35
	其中：股票	1,224,237,476.42	93.35
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	69,513,092.67	5.30
8	其他各项资产	17,691,528.46	1.35
9	合计	1,311,442,097.55	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	4,118.00	0.00
B	采矿业	10,883.00	0.00
C	制造业	187,700,346.90	14.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,180.00	0.00
E	建筑业	1,405,680.00	0.11
F	批发和零售业	54,706.19	0.00

G	交通运输、仓储和邮政业	527,378.41	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	180,172,863.01	13.86
J	金融业	442,210.00	0.03
K	房地产业	5,513,023.00	0.42
L	租赁和商务服务业	74,318,704.62	5.72
M	科学研究和技术服务业	26,122,528.14	2.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,379,010.11	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	14,447,781.00	1.11
Q	卫生和社会工作	6,707,731.00	0.52
R	文化、体育和娱乐业	725,428,333.04	55.79
S	综合	-	-
	合计	1,224,237,476.42	94.15

### 8.2.2 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。

### 8.3 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	8,720,950	113,546,769.00	8.73
2	300251	光线传媒	13,802,880	112,493,472.00	8.65
3	603103	横店影视	5,480,760	97,447,912.80	7.49
4	600977	中国电影	7,206,400	88,206,336.00	6.78
5	601599	浙文影业	18,205,400	77,372,950.00	5.95
6	300133	华策影视	11,728,100	68,843,947.00	5.29
7	002343	慈文传媒	9,703,136	63,458,509.44	4.88
8	000156	华数传媒	6,347,100	46,778,127.00	3.60
9	002292	奥飞娱乐	4,725,304	41,346,410.00	3.18
10	002707	众信旅游	5,062,958	36,149,520.12	2.78
11	000892	欢瑞世纪	8,727,400	35,695,066.00	2.75
12	300182	捷成股份	5,022,900	25,516,332.00	1.96
13	600959	江苏有线	7,531,500	23,648,910.00	1.82
14	600637	东方明珠	3,090,500	23,240,560.00	1.79
15	000607	华媒控股	4,424,300	20,263,294.00	1.56
16	002712	思美传媒	3,320,400	18,859,872.00	1.45
17	300299	富春股份	3,158,100	18,222,237.00	1.40
18	301231	荣信文化	664,300	16,906,435.00	1.30
19	300043	星辉娱乐	3,767,600	13,977,796.00	1.07
20	600556	天下秀	2,117,500	12,514,425.00	0.96

21	300612	宣亚国际	540,500	10,350,575.00	0.80
22	000917	电广传媒	1,886,000	10,335,280.00	0.79
23	688327	云从科技	483,707	8,155,300.02	0.63
24	301025	读客文化	714,200	8,106,170.00	0.62
25	300770	新媒股份	207,600	8,029,968.00	0.62
26	300081	恒信东方	676,100	7,808,955.00	0.60
27	002291	遥望科技	781,000	7,325,780.00	0.56
28	601929	吉视传媒	3,860,900	7,026,838.00	0.54
29	301270	汉仪股份	169,553	6,739,731.75	0.52
30	301060	兰卫医学	503,600	6,692,844.00	0.51
31	002659	凯文教育	1,462,000	6,330,460.00	0.49
32	003032	传智教育	437,000	6,292,800.00	0.48
33	300651	金陵体育	312,100	6,235,758.00	0.48
34	002858	力盛体育	290,100	5,511,900.00	0.42
35	000558	莱茵体育	1,881,000	5,511,330.00	0.42
36	600229	城市传媒	706,900	5,337,095.00	0.41
37	600831	广电网络	1,017,000	5,329,080.00	0.41
38	300113	顺网科技	364,100	5,097,400.00	0.39
39	000710	贝瑞基因	426,900	4,917,888.00	0.38
40	002520	日发精机	684,400	4,503,352.00	0.35
41	300248	新开普	461,600	4,426,744.00	0.34
42	002624	完美世界	366,300	4,336,992.00	0.33
43	600037	歌华有线	560,000	4,328,800.00	0.33
44	002878	元隆雅图	218,800	4,071,868.00	0.31
45	688181	八亿时空	125,238	3,381,426.00	0.26
46	000676	智度股份	363,600	3,174,228.00	0.24
47	300071	福石控股	858,400	2,970,064.00	0.23
48	601500	通用股份	701,000	2,902,140.00	0.22
49	300115	长盈精密	218,400	2,893,800.00	0.22
50	001330	博纳影业	397,500	2,862,000.00	0.22
51	603587	地素时尚	216,800	2,842,248.00	0.22
52	688322	奥比中光	75,513	2,837,778.54	0.22
53	300291	百纳千成	434,000	2,794,960.00	0.21
54	688315	诺禾致源	119,320	2,784,928.80	0.21
55	600936	广西广电	755,000	2,770,850.00	0.21
56	603489	八方股份	47,680	2,620,016.00	0.20
57	688179	阿拉丁	135,988	2,605,530.08	0.20
58	688158	优刻得	151,679	2,495,119.55	0.19
59	600825	新华传媒	528,800	2,363,736.00	0.18
60	000665	湖北广电	487,500	2,340,000.00	0.18
61	000681	视觉中国	148,500	2,182,950.00	0.17
62	603825	华扬联众	171,000	2,065,680.00	0.16
63	301045	天禄科技	71,700	1,950,240.00	0.15

64	300315	掌趣科技	366,600	1,887,990.00	0.15
65	688133	泰坦科技	39,280	1,820,628.00	0.14
66	603999	读者传媒	262,900	1,806,123.00	0.14
67	688137	近岸蛋白	31,092	1,724,984.16	0.13
68	002605	姚记科技	76,400	1,697,608.00	0.13
69	300860	锋尚文化	29,400	1,606,122.00	0.12
70	603258	电魂网络	69,700	1,601,706.00	0.12
71	688459	哈铁科技	156,313	1,463,089.68	0.11
72	002425	凯撒文化	322,400	1,441,128.00	0.11
73	301011	华立科技	61,100	1,429,740.00	0.11
74	300676	华大基因	29,500	1,416,000.00	0.11
75	002247	聚力文化	589,800	1,380,132.00	0.11
76	300815	玉禾田	91,900	1,341,740.00	0.10
77	300192	科德教育	132,600	1,308,762.00	0.10
78	300790	宇瞳光学	80,000	1,301,600.00	0.10
79	300946	恒而达	40,000	1,290,800.00	0.10
80	002400	省广集团	226,100	1,254,855.00	0.10
81	688722	同益中	77,533	1,186,254.90	0.09
82	688582	芯动联科	30,638	1,184,771.46	0.09
83	688028	沃尔德	47,519	1,182,747.91	0.09
84	688277	天智航	89,726	1,182,588.68	0.09
85	300853	申昊科技	42,000	1,142,400.00	0.09
86	002582	好想你	143,400	1,099,878.00	0.08
87	301193	家联科技	57,600	978,048.00	0.08
88	000032	深桑达 A	46,100	976,398.00	0.08
89	301230	泓博医药	26,280	940,824.00	0.07
90	002722	物产金轮	58,300	898,403.00	0.07
91	688049	炬芯科技	23,315	887,602.05	0.07
92	300114	中航电测	20,000	875,000.00	0.07
93	002402	和而泰	59,700	853,113.00	0.07
94	600006	东风汽车	147,000	848,190.00	0.07
95	688690	纳微科技	30,582	838,558.44	0.06
96	688105	诺唯赞	25,632	820,736.64	0.06
97	688084	晶品特装	10,600	794,470.00	0.06
98	300759	康龙化成	27,100	785,358.00	0.06
99	603533	掌阅科技	39,200	779,296.00	0.06
100	301313	凡拓数创	21,100	760,866.00	0.06
101	002240	盛新锂能	31,300	712,075.00	0.05
102	002348	高乐股份	182,500	702,625.00	0.05
103	688165	埃夫特	60,000	687,600.00	0.05
104	605168	三人行	10,100	639,936.00	0.05
105	000848	承德露露	78,700	617,795.00	0.05
106	688400	凌云光	22,621	610,767.00	0.05

107	688227	品高股份	31,194	594,869.58	0.05
108	300264	佳创视讯	68,200	559,922.00	0.04
109	002957	科瑞技术	27,500	528,275.00	0.04
110	688297	中无人机	13,437	515,040.21	0.04
111	603128	华贸物流	69,100	510,649.00	0.04
112	002174	游族网络	43,500	498,510.00	0.04
113	601966	玲珑轮胎	23,900	459,597.00	0.04
114	300065	海兰信	44,100	448,497.00	0.03
115	301321	翰博高新	23,000	438,380.00	0.03
116	601658	邮储银行	96,000	417,600.00	0.03
117	688515	裕太微	4,200	415,002.00	0.03
118	300984	金沃股份	13,900	388,644.00	0.03
119	688099	晶晨股份	6,200	388,306.00	0.03
120	300148	天舟文化	102,800	387,556.00	0.03
121	601921	浙版传媒	47,100	359,844.00	0.03
122	601098	中南传媒	35,000	355,950.00	0.03
123	002475	立讯精密	10,100	347,945.00	0.03
124	001206	依依股份	21,100	332,958.00	0.03
125	301296	新巨丰	30,500	314,150.00	0.02
126	603888	新华网	12,100	304,799.00	0.02
127	600730	中国高科	52,400	296,060.00	0.02
128	002891	中宠股份	10,100	266,135.00	0.02
129	300170	汉得信息	31,100	258,441.00	0.02
130	000802	北京文化	33,700	244,662.00	0.02
131	605299	舒华体育	24,100	238,590.00	0.02
132	002555	三七互娱	12,500	235,125.00	0.02
133	603936	博敏电子	22,200	231,768.00	0.02
134	002995	天地在线	10,160	231,140.00	0.02
135	002607	中公教育	50,000	204,000.00	0.02
136	002354	天娱数科	33,000	182,160.00	0.01
137	688222	成都先导	12,000	179,880.00	0.01
138	301079	邵阳液压	10,000	173,000.00	0.01
139	603982	泉峰汽车	11,100	159,951.00	0.01
140	688665	四方光电	2,000	147,520.00	0.01
141	300809	华辰装备	4,900	143,325.00	0.01
142	300390	天华新能	5,600	141,960.00	0.01
143	600551	时代出版	12,800	139,392.00	0.01
144	688271	联影医疗	1,000	137,010.00	0.01
145	603081	大丰实业	10,000	136,200.00	0.01
146	600640	国脉文化	11,200	128,464.00	0.01
147	688381	帝奥微	5,000	126,600.00	0.01
148	688343	云天励飞	2,400	118,200.00	0.01
149	601868	中国能建	53,900	113,190.00	0.01

150	300027	华谊兄弟	41,800	112,024.00	0.01
151	688439	振华风光	1,200	106,932.00	0.01
152	002773	康弘药业	5,500	101,420.00	0.01
153	002708	光洋股份	11,900	98,532.00	0.01
154	603127	昭衍新药	4,100	97,211.00	0.01
155	300242	佳云科技	24,500	96,775.00	0.01
156	600633	浙数文化	8,700	96,222.00	0.01
157	688777	中控技术	2,100	95,235.00	0.01
158	300008	天海防务	23,000	91,540.00	0.01
159	002446	盛路通信	11,000	91,300.00	0.01
160	301047	义翘神州	1,100	90,640.00	0.01
161	002051	中工国际	11,100	90,132.00	0.01
162	300609	汇纳科技	3,300	90,090.00	0.01
163	301518	长华化学	3,850	89,939.85	0.01
164	688648	中邮科技	3,303	85,483.29	0.01
165	600880	博瑞传播	17,000	85,170.00	0.01
166	688393	安必平	3,399	84,873.03	0.01
167	603636	南威软件	6,600	84,612.00	0.01
168	300673	佩蒂股份	6,000	79,800.00	0.01
169	688358	祥生医疗	2,000	75,560.00	0.01
170	002859	洁美科技	3,000	74,850.00	0.01
171	300671	富满微	2,300	74,359.00	0.01
172	688307	中润光学	2,200	68,420.00	0.01
173	688319	欧林生物	4,000	63,200.00	0.00
174	600733	北汽蓝谷	10,200	62,526.00	0.00
175	301133	金钟股份	2,000	55,140.00	0.00
176	601186	中国铁建	7,000	53,270.00	0.00
177	688561	奇安信	1,200	48,108.00	0.00
178	002268	电科网安	2,100	47,166.00	0.00
179	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
180	300725	药石科技	1,100	43,197.00	0.00
181	002886	沃特股份	2,100	43,029.00	0.00
182	688131	皓元医药	800	41,648.00	0.00
183	601390	中国中铁	7,100	40,328.00	0.00
184	601800	中国交建	5,200	39,520.00	0.00
185	688238	和元生物	4,000	35,960.00	0.00
186	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
187	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
188	688110	东芯股份	1,000	34,430.00	0.00
189	688608	恒玄科技	200	30,854.00	0.00
190	300760	迈瑞医疗	100	29,060.00	0.00
191	688548	广钢气体	2,191	27,935.25	0.00
192	688235	百济神州	200	27,808.00	0.00

193	688507	索辰科技	200	27,350.00	0.00
194	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
195	688639	华恒生物	200	25,180.00	0.00
196	301525	儒竞科技	302	24,892.92	0.00
197	688702	盛科通信	494	23,800.92	0.00
198	688563	航材股份	366	22,139.34	0.00
199	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
200	688266	泽璟制药	400	21,176.00	0.00
201	688083	中望软件	200	19,908.00	0.00
202	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
203	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
204	301559	中集环科	1,033	18,841.92	0.00
205	688577	浙海德曼	200	18,840.00	0.00
206	300607	拓斯达	1,200	18,804.00	0.00
207	600576	祥源文旅	2,500	18,600.00	0.00
208	301511	德福科技	818	18,544.06	0.00
209	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
210	300674	宇信科技	1,100	17,908.00	0.00
211	688114	华大智造	200	17,204.00	0.00
212	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
213	600081	东风科技	1,500	16,845.00	0.00
214	688392	骄成超声	200	16,682.00	0.00
215	301498	乖宝宠物	428	16,610.68	0.00
216	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
217	600706	曲江文旅	1,100	16,302.00	0.00
218	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
219	301262	海看股份	508	15,824.20	0.00
220	301486	致尚科技	333	15,734.25	0.00
221	301566	达利凯普	709	15,697.26	0.00
222	301468	博盈特焊	517	15,623.74	0.00
223	300016	北陆药业	2,100	14,952.00	0.00
224	688217	睿昂基因	400	14,312.00	0.00
225	300244	迪安诊断	600	14,286.00	0.00
226	688041	海光信息	200	14,196.00	0.00
227	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
228	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
229	001306	夏厦精密	164	13,888.04	0.00
230	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
231	600636	国新文化	1,300	13,702.00	0.00
232	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
233	300374	中铁装配	1,100	13,453.00	0.00
234	688363	华熙生物	200	13,386.00	0.00
235	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00

236	301393	昊帆生物	204	12,111.48	0.00
237	002905	金逸影视	1,100	12,056.00	0.00
238	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
239	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
240	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
241	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
242	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
243	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
244	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
245	600661	昂立教育	1,000	10,700.00	0.00
246	688626	翔宇医疗	200	10,658.00	0.00
247	300528	幸福蓝海	1,000	10,630.00	0.00
248	301371	敷尔佳	282	10,597.56	0.00
249	688612	威迈斯	275	10,441.75	0.00
250	600827	百联股份	1,100	10,439.00	0.00
251	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
252	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
253	688311	盟升电子	200	10,202.00	0.00
254	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
255	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
256	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
257	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
258	688568	中科星图	200	9,812.00	0.00
259	688071	华依科技	200	9,742.00	0.00
260	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
261	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
262	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
263	603195	公牛集团	100	9,565.00	0.00
264	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
265	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
266	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
267	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
268	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
269	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
270	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
271	688286	敏芯股份	124	8,890.80	0.00
272	301052	果麦文化	200	8,756.00	0.00
273	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
274	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
275	688180	君实生物	200	8,366.00	0.00
276	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
277	601198	东兴证券	1,000	8,230.00	0.00
278	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00



279	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
280	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
281	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
282	688078	龙软科技	200	8,064.00	0.00
283	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
284	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
285	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
286	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
287	688448	磁谷科技	200	7,766.00	0.00
288	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
289	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
290	688385	复旦微电	200	7,726.00	0.00
291	688265	南模生物	200	7,690.00	0.00
292	301170	锡南科技	250	7,607.50	0.00
293	688003	天准科技	200	7,504.00	0.00
294	002599	盛通股份	1,100	7,337.00	0.00
295	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
296	603259	药明康德	100	7,276.00	0.00
297	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
298	002977	天箭科技	200	7,084.00	0.00
299	688233	神工股份	200	7,058.00	0.00
300	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
301	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
302	688246	嘉和美康	200	6,684.00	0.00
303	300951	博硕科技	100	6,478.00	0.00
304	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
305	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
306	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
307	002192	融捷股份	100	5,421.00	0.00
308	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
309	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
310	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
311	000526	学大教育	100	4,999.00	0.00
312	000572	海马汽车	1,000	4,910.00	0.00
313	688127	蓝特光学	200	4,658.00	0.00
314	002841	视源股份	100	4,576.00	0.00
315	301159	三维天地	100	4,563.00	0.00
316	300781	因赛集团	100	4,500.00	0.00
317	603661	恒林股份	100	4,457.00	0.00
318	688039	当虹科技	119	4,303.04	0.00
319	300280	紫天科技	100	4,273.00	0.00
320	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
321	603486	科沃斯	100	4,144.00	0.00

322	601595	上海电影	160	4,132.80	0.00
323	002714	牧原股份	100	4,118.00	0.00
324	688046	药康生物	200	4,030.00	0.00
325	688207	格灵深瞳	192	4,024.32	0.00
326	603583	捷昌驱动	200	4,006.00	0.00
327	301306	西测测试	100	3,959.00	0.00
328	600373	中文传媒	300	3,954.00	0.00
329	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
330	601995	中金公司	100	3,805.00	0.00
331	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
332	688772	珠海冠宇	168	3,697.68	0.00
333	300556	丝路视觉	100	3,685.00	0.00
334	002933	新兴装备	100	3,645.00	0.00
335	603816	顾家家居	100	3,500.00	0.00
336	001316	润贝航科	100	3,481.00	0.00
337	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
338	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
339	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
340	603915	国茂股份	200	3,296.00	0.00
341	603666	亿嘉和	100	3,139.00	0.00
342	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
343	300688	创业黑马	100	2,871.00	0.00
344	000762	西藏矿业	100	2,860.00	0.00
345	301029	怡合达	100	2,578.00	0.00
346	002362	汉王科技	100	2,562.00	0.00
347	300450	先导智能	100	2,560.00	0.00
348	002903	宇环数控	100	2,555.00	0.00
349	603180	金牌厨柜	100	2,509.00	0.00
350	300898	熊猫乳品	100	2,416.00	0.00
351	301377	鼎泰高科	100	2,365.00	0.00
352	688336	三生国健	100	2,251.00	0.00
353	002979	雷赛智能	100	2,155.00	0.00
354	600938	中国海油	100	2,097.00	0.00
355	300007	汉威科技	100	2,078.00	0.00
356	603598	引力传媒	100	2,068.00	0.00
357	300634	彩讯股份	100	2,047.00	0.00
358	600030	中信证券	100	2,037.00	0.00
359	603108	润达医疗	100	2,035.00	0.00
360	300748	金力永磁	100	2,022.00	0.00
361	301171	易点天下	100	1,977.00	0.00
362	600593	大连圣亚	100	1,966.00	0.00
363	300657	弘信电子	100	1,939.00	0.00
364	603611	诺力股份	100	1,893.00	0.00

365	002181	粤传媒	400	1,840.00	0.00
366	300416	苏试试验	100	1,837.00	0.00
367	300752	隆利科技	100	1,817.00	0.00
368	300845	捷安高科	100	1,807.00	0.00
369	300445	康斯特	100	1,743.00	0.00
370	300235	方直科技	150	1,720.50	0.00
371	300494	盛天网络	100	1,581.00	0.00
372	600757	长江传媒	200	1,490.00	0.00
373	601156	东航物流	100	1,478.00	0.00
374	002176	江特电机	100	1,350.00	0.00
375	000155	川能动力	100	1,329.00	0.00
376	000503	国新健康	100	1,318.00	0.00
377	603708	家家悦	100	1,307.00	0.00
378	002941	新疆交建	100	1,302.00	0.00
379	002966	苏州银行	200	1,292.00	0.00
380	300421	力星股份	100	1,291.00	0.00
381	002122	汇洲智能	300	1,251.00	0.00
382	603569	长久物流	100	1,239.00	0.00
383	603055	台华新材	100	1,204.00	0.00
384	603093	南华期货	100	1,200.00	0.00
385	300455	航天智装	100	1,194.00	0.00
386	600446	金证股份	100	1,157.00	0.00
387	300805	电声股份	100	1,120.00	0.00
388	300426	唐德影视	100	1,103.00	0.00
389	601456	国联证券	100	1,084.00	0.00
390	002637	赞宇科技	100	1,073.00	0.00
391	300063	天龙集团	150	1,045.50	0.00
392	601878	浙商证券	100	1,043.00	0.00
393	000719	中原传媒	100	973.00	0.00
394	000829	天音控股	100	954.00	0.00
395	001979	招商蛇口	100	953.00	0.00
396	603528	多伦科技	100	908.00	0.00
397	600109	国金证券	100	908.00	0.00
398	601928	凤凰传媒	100	881.00	0.00
399	000800	一汽解放	100	850.00	0.00
400	002424	贵州百灵	100	811.00	0.00
401	601901	方正证券	100	806.00	0.00
402	603887	城地香江	100	804.00	0.00
403	601108	财通证券	100	776.00	0.00
404	002120	韵达股份	100	746.00	0.00
405	300102	乾照光电	100	735.00	0.00
406	601555	东吴证券	100	731.00	0.00
407	000700	模塑科技	100	700.00	0.00

408	601801	皖新传媒	100	695.00	0.00
409	601577	长沙银行	100	682.00	0.00
410	600061	国投资本	100	674.00	0.00
411	002092	中泰化学	100	610.00	0.00
412	002044	美年健康	100	601.00	0.00
413	000521	长虹美菱	100	563.00	0.00
414	000783	长江证券	100	538.00	0.00
415	601598	中国外运	100	524.00	0.00
416	600497	驰宏锌锗	100	505.00	0.00
417	600052	东望时代	100	499.00	0.00
418	600023	浙能电力	100	461.00	0.00
419	600383	金地集团	100	436.00	0.00
420	603323	苏农银行	100	416.00	0.00
421	600863	内蒙华电	100	390.00	0.00
422	002839	张家港行	100	388.00	0.00
423	600376	首开股份	100	304.00	0.00
424	600715	文投控股	100	265.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	139,609,641.44	99.99
2	300251	光线传媒	123,009,049.92	88.10
3	600977	中国电影	99,775,419.14	71.46
4	603103	横店影视	91,219,588.94	65.33
5	300133	华策影视	76,127,397.34	54.52
6	002343	慈文传媒	69,081,919.20	49.48
7	601599	浙文影业	68,458,543.00	49.03
8	000156	华数传媒	55,252,155.00	39.57
9	002707	众信旅游	46,772,487.06	33.50
10	000892	欢瑞世纪	40,104,718.00	28.72
11	002292	奥飞娱乐	30,695,383.55	21.98
12	002712	思美传媒	30,295,662.30	21.70
13	300182	捷成股份	29,265,560.62	20.96
14	600637	东方明珠	28,604,318.78	20.49
15	600959	江苏有线	27,565,390.35	19.74
16	000607	华媒控股	23,046,473.00	16.51
17	300299	富春股份	21,830,536.69	15.64
18	301231	荣信文化	19,954,542.36	14.29
19	300063	天龙集团	19,815,221.00	14.19
20	000676	智度股份	16,542,286.49	11.85
21	600715	文投控股	15,343,371.00	10.99

22	300770	新媒股份	14,275,296.60	10.22
23	601995	中金公司	13,952,668.00	9.99
24	600556	天下秀	13,629,420.00	9.76
25	300043	星辉娱乐	13,371,277.00	9.58
26	300612	宣亚国际	12,902,520.00	9.24
27	000917	电广传媒	12,350,178.76	8.85
28	001323	慕思股份	12,037,959.42	8.62
29	603598	引力传媒	11,611,773.00	8.32
30	002599	盛通股份	11,189,088.00	8.01
31	003032	传智教育	11,065,389.13	7.93
32	300651	金陵体育	9,911,230.00	7.10
33	301025	读客文化	9,411,499.97	6.74
34	301060	兰卫医学	9,103,026.42	6.52
35	300781	因赛集团	9,099,810.00	6.52
36	688327	云从科技	8,587,158.92	6.15
37	002605	姚记科技	8,583,559.00	6.15
38	603887	城地香江	8,581,618.40	6.15
39	688181	八亿时空	8,552,006.54	6.12
40	002878	元隆雅图	8,493,629.00	6.08
41	002291	遥望科技	8,238,994.00	5.90
42	601929	吉视传媒	7,622,660.00	5.46
43	301270	汉仪股份	7,359,485.53	5.27
44	002659	凯文教育	7,214,855.00	5.17
45	002247	聚力文化	7,092,077.00	5.08
46	300081	恒信东方	6,687,268.00	4.79
47	600229	城市传媒	6,551,061.00	4.69
48	600266	城建发展	6,497,862.12	4.65
49	001316	润贝航科	6,267,026.00	4.49
50	600831	广电网络	6,070,132.00	4.35
51	000558	莱茵体育	6,002,116.00	4.30
52	000155	川能动力	5,821,735.00	4.17
53	000710	贝瑞基因	5,760,037.00	4.13
54	600037	歌华有线	5,669,014.00	4.06
55	603825	华扬联众	5,661,633.00	4.05
56	300113	顺网科技	5,608,324.00	4.02
57	603729	龙韵股份	5,199,343.00	3.72
58	600825	新华传媒	5,158,193.00	3.69
59	002858	力盛体育	4,968,843.00	3.56
60	002624	完美世界	4,839,503.00	3.47
61	002180	纳思达	4,832,615.00	3.46
62	300528	幸福蓝海	4,789,888.00	3.43
63	300248	新开普	4,604,359.00	3.30
64	600827	百联股份	4,496,521.00	3.22

65	600446	金证股份	4,491,909.00	3.22
66	600577	精达股份	4,344,605.00	3.11
67	601595	上海电影	4,337,677.00	3.11
68	002520	日发精机	4,294,117.00	3.08
69	600052	东望时代	4,286,108.00	3.07
70	300609	汇纳科技	4,264,905.00	3.05
71	300860	锋尚文化	4,184,997.42	3.00
72	688699	明微电子	4,036,163.80	2.89
73	001330	博纳影业	3,946,059.00	2.83
74	300805	电声股份	3,654,795.00	2.62
75	002995	天地在线	3,488,347.00	2.50
76	688049	炬芯科技	3,483,165.01	2.49
77	688488	艾迪药业	3,449,803.84	2.47
78	300071	福石控股	3,448,544.00	2.47
79	603587	地素时尚	3,365,060.00	2.41
80	300115	长盈精密	3,167,644.80	2.27
81	601878	浙商证券	3,119,854.00	2.23
82	300291	百纳千成	3,081,439.00	2.21
83	688315	诺禾致源	3,049,314.64	2.18
84	600936	广西广电	2,983,075.00	2.14
85	688179	阿拉丁	2,868,628.70	2.05
86	000681	视觉中国	2,838,721.00	2.03
87	601500	通用股份	2,817,725.00	2.02
88	688158	优刻得	2,809,912.09	2.01

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300063	天龙集团	29,371,247.65	21.04
2	002739	万达电影	24,642,800.63	17.65
3	603598	引力传媒	22,801,504.80	16.33
4	601595	上海电影	22,697,497.10	16.26
5	300781	因赛集团	20,742,113.30	14.86
6	600715	文投控股	19,118,693.00	13.69
7	002599	盛通股份	17,281,732.00	12.38
8	601995	中金公司	14,176,569.00	10.15
9	000676	智度股份	13,754,360.00	9.85
10	002605	姚记科技	12,039,750.00	8.62
11	001323	慕思股份	11,465,732.54	8.21
12	002712	思美传媒	8,581,339.00	6.15
13	600827	百联股份	8,101,995.84	5.80
14	002707	众信旅游	8,030,426.00	5.75

15	603887	城地香江	7,983,221.00	5.72
16	600266	城建发展	7,457,905.00	5.34
17	300251	光线传媒	7,185,779.00	5.15
18	300144	宋城演艺	7,030,069.65	5.03
19	603729	龙韵股份	6,781,578.06	4.86
20	300770	新媒股份	6,392,358.00	4.58
21	600258	首旅酒店	6,311,014.92	4.52
22	001316	润贝航科	5,716,976.00	4.09
23	002247	聚力文化	5,665,090.00	4.06
24	300528	幸福蓝海	5,656,246.40	4.05
25	600138	中青旅	5,591,999.46	4.01
26	000155	川能动力	5,442,981.00	3.90
27	300609	汇纳科技	5,361,876.00	3.84
28	603103	横店影视	5,101,719.46	3.65
29	002180	纳思达	4,986,942.00	3.57
30	002995	天地在线	4,906,021.40	3.51
31	002878	元隆雅图	4,606,371.00	3.30
32	688181	八亿时空	4,509,230.38	3.23
33	600577	精达股份	4,193,433.00	3.00
34	600052	东望时代	4,096,669.40	2.93
35	003032	传智教育	4,096,461.00	2.93
36	300805	电声股份	3,805,496.00	2.73
37	600637	东方明珠	3,785,454.12	2.71
38	603825	华扬联众	3,770,500.00	2.70
39	600446	金证股份	3,639,240.00	2.61
40	688699	明微电子	3,638,349.10	2.61
41	600977	中国电影	3,504,830.00	2.51
42	688488	艾迪药业	3,493,457.23	2.50
43	600757	长江传媒	3,172,216.00	2.27
44	601878	浙商证券	3,038,540.00	2.18
45	603518	锦泓集团	2,997,316.00	2.15
46	300494	盛天网络	2,993,367.80	2.14
47	688049	炬芯科技	2,900,163.80	2.08
48	688039	当虹科技	2,856,765.19	2.05
49	300860	锋尚文化	2,853,096.00	2.04
50	688207	格灵深瞳	2,792,651.82	2.00

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。

#### 8.4.3 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	1,704,277,349.36
卖出股票收入（成交）总额	584,209,782.10

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

##### 8.11.2 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 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。

##### 8.12.2 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。

##### 8.12.3 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	304,673.99



2	应收清算款	196,617.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,190,236.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,691,528.46

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)
泰信行业精选混合 A	98,288	5,333.01	146,773,467.36	28.00	377,397,215.24	72.00
泰信行业精选混合 C	28,908	6,493.28	16,290,167.82	8.68	171,417,636.20	91.32
合计	127,196	5,596.70	163,063,635.18	22.91	548,814,851.44	77.09

### 9.2 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	969,545.61	0.1850
	泰信行业精选混合 C	181,096.57	0.0965

	合计	1,150,642.18	0.1616
--	----	--------------	--------

### 9.3 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	10~50
	合计	10~50
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。

## § 10 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份额	990,139,755.27	509,742,725.70
减：本报告期基金总赎回份额	538,104,652.85	336,444,330.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	524,170,682.60	187,707,804.02

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

## 11.2 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

经泰信基金管理有限公司董事会审议通过,自 2023 年 8 月 23 日起,董事长李高峰先生代任公司总经理职务,高宇先生不再担任公司总经理职务。具体详情参见 2023 年 8 月 23 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站(www.ftfund.com)上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

本公司上述人事变动已按相关规定进行备案。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内,无涉基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金进行审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所审计费为人民币 5.78 万元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	1,417,770,502.29	62.30	1,313,392.73	67.23	-
华创证券	2	858,103,823.72	37.70	640,065.08	32.77	-

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：华创证券上海 46366、华创证券深圳 017221；退租交易单元：无。

### 11.7.2 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	-	-	361,263,000.00	100.00	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	《上海证券报》、规定网站	2023 年 3 月 9 日

	通转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告		
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	《上海证券报》、规定网	2023 年 5 月 29 日

	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	站	
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
25	关于旗下部分开放式基金新增奕丰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 7 月 17 日
26	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第二季度报告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 7 月 20 日
27	关于旗下部分开放式基金新增万家财富基金销售(天津)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 7 月 21 日
28	关于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额新增国金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	《上海证券报》、规定网站	2023 年 7 月 27 日
29	关于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额新增中信证券、中信证券(山东)、中信证券华南、中信期货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 8 月 4 日
30	关于旗下部分开放式基金新增中信建投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	《上海证券报》、规定网站	2023 年 8 月 8 日
31	泰信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和托管费率并修订基金合同等事项的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 8 月 12 日
32	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 3 号)、产品资料概要更新、基金合同、托管协议	《上海证券报》、规定网站	2023 年 8 月 12 日
33	关于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额在南京证券股份有限公司调整最低申购金额、最低赎	《上海证券报》、规定网站	2022 年 8 月 18 日

	回份额和最低保有份额的公告		
34	泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 8 月 23 日
35	关于旗下部分开放式基金在金元证券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 8 月 24 日
36	关于旗下部分开放式基金新增腾安基金为销售机构并开通转换、定投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 8 月 25 日
37	关于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额在平安证券股份有限公司调整最低申购金额、最低赎回份额和最低保有份额的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 8 月 29 日
38	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金暂停机构投资者大额申购、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 8 月 29 日
39	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 8 月 30 日
40	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	《上海证券报》、规定网站	2023 年 8 月 30 日
41	关于旗下部分开放式基金新增上海华夏财富投资管理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公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 9 月 18 日
42	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 9 月 25 日
43	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 9 月 26 日
44	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第三季度报告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 10 月 24 日
45	泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额新增国泰君安证券股份有限公司为销售机构并开通转换、定投业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 11 月 1 日
46	关于旗下部分开放式基金新增嘉实财富管理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 11 月 16 日
47	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 11 月 20 日
48	关于旗下部分开放式基金新增深圳众禄基金销售股份有限公司为销售机构	《上海证券报》、规定网站	2023 年 11 月 21 日

	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		
49	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 11 月 21 日
50	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 12 月 18 日
51	关于旗下部分基金新增上海中欧财富基金销售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 12 月 20 日
52	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 12 月 20 日
53	关于泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额新增中信银行股份有限公司为销售机构并开通定投、转换业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 12 月 21 日
54	泰信基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所股票及相关风险提示的公告	《上海证券报》、规定网站	2023 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20231103 - 20231109	0.00	100,481,706.55	0.00	100,481,706.55	14.12

#### 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、为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》（以下简称《招募说明书》）的相关



条款。

2、为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，泰信基金管理有限公司决定自 2023 年 8 月 14 日起，调低本基金的管理费率和/或托管费率并对基金合同有关条款进行修订。详情请参见 2023 年 8 月 12 日发布《泰信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修订基金合同等事项的公告》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、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、基金托管人业务资格批件和营业执照

### 13.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

### 13.3 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

2024 年 3 月 28 日