

泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	16
§5 托管人报告	17
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	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.11 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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.....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50

§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	泰信鑫益定期开放	
基金主代码	000212	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2013 年 7 月 17 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	48,351,002.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰信鑫益定期开放 A	泰信鑫益定期开放 C
下属分级基金的交易代码:	000212	000213
报告期末下属分级基金的份额总额	43,220,980.92 份	5,130,021.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金投资将追求资金的安全与长期稳定增长，并力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例，在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+0.5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗丽娟	罗丹丹
	联系电话	021-20899098	4006800000
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	luodandan@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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1

	区浦东南路 256 号 华夏银行大厦 36-37 层	号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200120	100020
法定代表人	万众	李庆萍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	泰信鑫益定期开放 A	泰信鑫益定期开放 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,109,898.44	107,773.50
本期利润	976,495.54	93,649.98
加权平均基金份额本期利润	0.0196	0.0170
本期加权平均净值利润率	1.62%	1.44%
本期基金份额净值增长率	1.66%	1.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	7,393,512.00	749,010.80
期末可供分配基金份额利润	0.1711	0.1460
期末基金资产净值	52,982,779.73	6,157,107.94
期末基金份额净值	1.226	1.200
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	43.25%	38.64%

注：1、本基金合同于 2013 年 7 月 17 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

泰信鑫益定期开放 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.49%	0.05%	0.17%	0.01%	0.32%	0.04%
过去三个月	1.41%	0.06%	0.51%	0.01%	0.90%	0.05%
过去六个月	1.66%	0.07%	1.01%	0.01%	0.65%	0.06%
过去一年	2.77%	0.07%	2.05%	0.01%	0.72%	0.06%
过去三年	13.20%	0.08%	6.28%	0.01%	6.92%	0.07%

自基金合同 生效起至今	43.25%	0.09%	20.86%	0.01%	22.39%	0.08%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

泰信鑫益定期开放 C

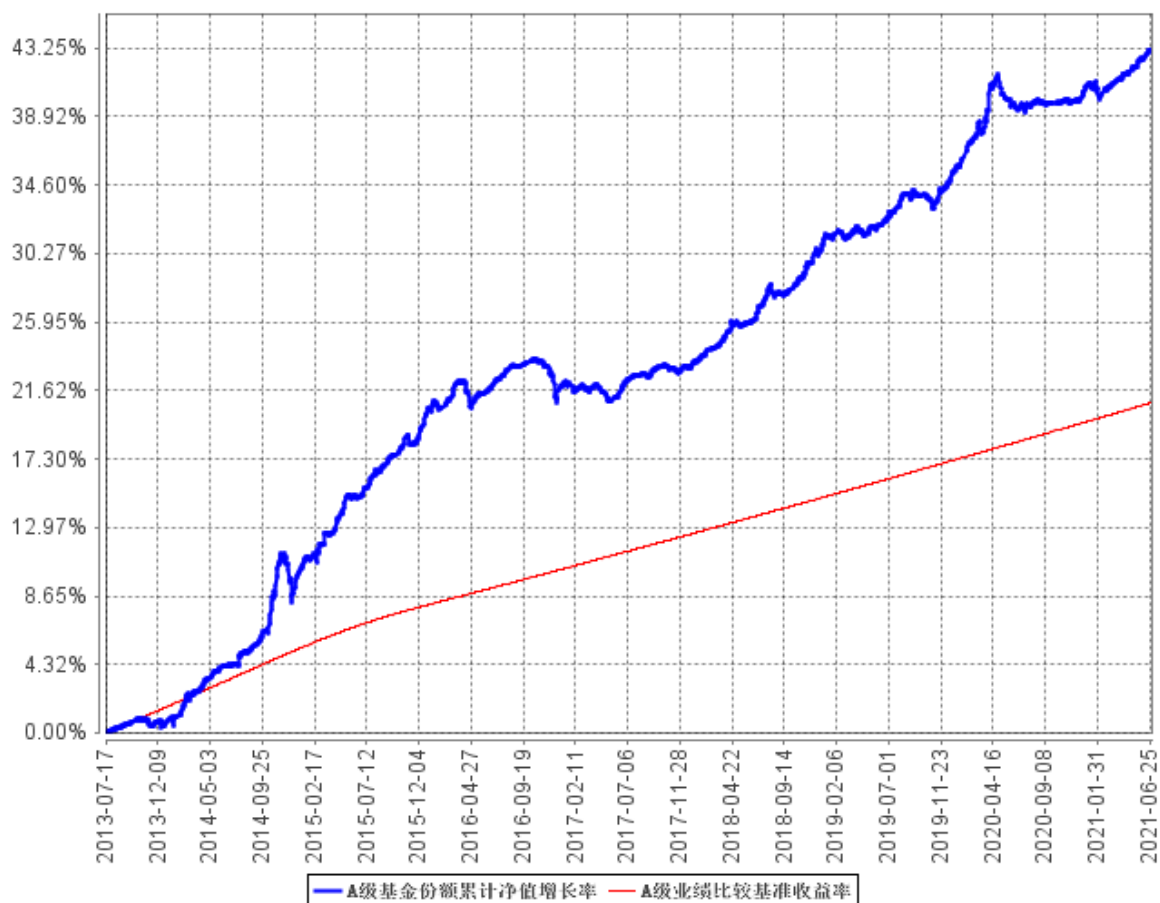
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	0.42%	0.06%	0.17%	0.01%	0.25%	0.05%
过去三个月	1.27%	0.06%	0.51%	0.01%	0.76%	0.05%
过去六个月	1.44%	0.08%	1.01%	0.01%	0.43%	0.07%
过去一年	2.30%	0.08%	2.05%	0.01%	0.25%	0.07%
过去三年	11.84%	0.09%	6.28%	0.01%	5.56%	0.08%
自基金合同 生效起至今	38.64%	0.09%	20.86%	0.01%	17.78%	0.08%

注：本基金业绩比较基准为：中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+0.5%。

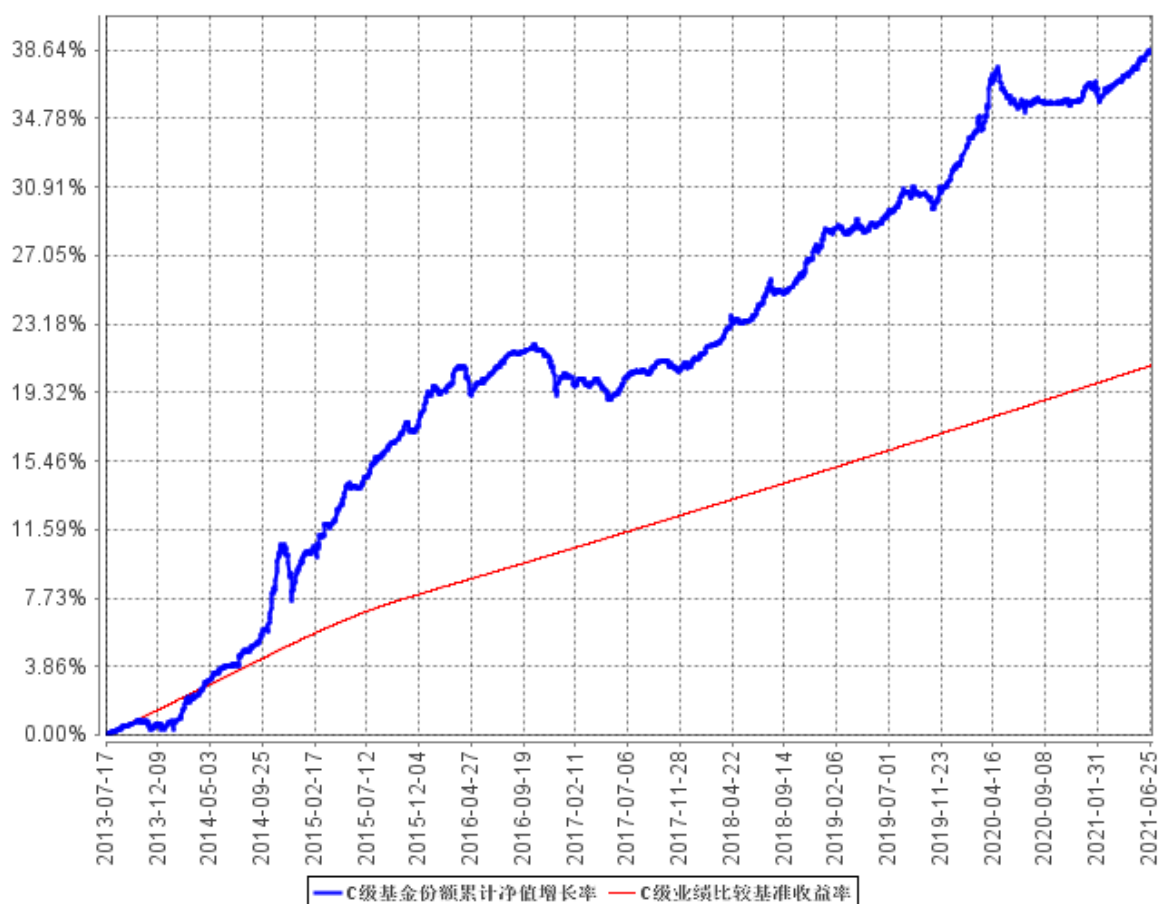
本基金是定期开放式债券型基金产品，每个运作周期为一年。为满足每个运作周期后自由开放期的流动性要求，本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与运作周期进行适当的匹配。以一年期定期存款基准利率税后+0.5%的收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，并合理地衡量比较本基金的业绩表现。

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

A级基金份额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



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2013 年 7 月 17 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或到期日在一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：高宇

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、综合管理部。截至 2021 年 6 月末，公司有正式员工 104 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 2021 年 6 月 30 日，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信基本面 400、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长、泰信鑫利混合、泰信竞争优选混合、泰信双债增利债券、泰信景气驱动 12 个月持有期共 23 只开放式基金及 27 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		
李俊江先生	泰信天天收益货币市场基金基金经理、泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金经理	2021 年 6 月 9 日	—	7 年	李俊江先生，中央财经大学投资学专业硕士，历任中债资信评估有限责任公司研究员，华创证券有限责任公司研究所研究员、资产管理部投资经理、投顾业务管理部（筹）研究员，江海证券有限公司资产管理投资部投资经理。2020 年 5 月加入泰信基金管理有限公司，曾任拟任基金经理，2020 年 6 月至今任泰信天天收益货币市场基金基金经理、2021 年 6 月至今任泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金经理。
何俊春女士	固收投资部固定收益投资总监、泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金经理、泰信双债增利债券型证券投资基金基金经理	2013 年 7 月 17 日	2021 年 6 月 9 日	25 年	何俊春女士，华东理工大学工商管理专业硕士。历任上海鸿安投资咨询有限公司清算员、齐鲁证券有限公司上海斜土路营业部项目经理。2002 年 12 月加入泰信基金管理有限公司，历任交易员、交易主管，现任固定收益投资总监。2008 年 10 月至 2020 年 9 月任泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理，2009 年 7 月至 2020 年 10 月任泰信增强收益债券型证券投资基金基金经理，2012 年 10 月至 2020 年 10 月任泰信周期回报债券型证券投资基金基金经理，2013 年 7 月至 2021 年 6 月任泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 10 月至 2021 年 2 月任泰信天天收益货币市场基金基金经理，2017 年 5 月至 2021 年 1 月任泰信鑫

					利混合型证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2021 年 6 月任泰信双债增利债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期以基金合同生效日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

年初生产和出口较好，实体经济融资需求旺盛，通胀预期有所升温。1 月税期央行大幅回笼

流动性引发流动性冲击，但 2 月以来央行保持流动性合理充裕，同时二季度经济边际走弱，市场对后期通胀预期有所缓解，整体资金面保持平稳宽松。6 月利率债发行加快引发市场对后续流动性及供给压力的担忧，资金面有所收紧。临近跨季，央行提高逆回购额度，维稳资金面信号明显，整体跨季压力不大。

鑫益定期开放基金上半年增加短久期信用债配置占比，精选转债个券布局，同时为了应对受限开放日赎回，纯债组合整体保持了中性久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰信鑫益定期开放 A 基金份额净值为 1.226 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.66%；截至本报告期末泰信鑫益定期开放 C 基金份额净值为 1.200 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.44%；同期业绩比较基准收益率为 1.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月降准落地带动长端利率快速下行，隐性债务管控、地产调控升级和局部疫情反复引发基本面对本担忧加剧，流动性易松难紧，叠加机构欠配，短期债市调整压力有限。另一方面，信用环境和信用利差分化仍会继续加剧，鑫益定开基金会继续防控信用风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红

利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、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。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，对泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金 2021 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，泰信管理有限公司在泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，泰信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 2021 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	475,441.76	224,293.59
结算备付金		96,289.55	88,153.50
存出保证金		11,203.15	6,547.33
交易性金融资产	6.4.7.2	65,296,680.00	76,139,615.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		60,293,680.00	76,139,615.40
资产支持证券投资		5,003,000.00	-
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	11,000,000.00	-
应收证券清算款		-	94,977.10
应收利息	6.4.7.5	1,377,935.27	980,744.44
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		78,257,549.73	77,534,331.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		19,007,771.49	8,900,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		33,936.45	40,370.21
应付托管费		9,696.13	11,534.34
应付销售服务费		2,019.26	2,224.28
应付交易费用	6.4.7.7	3,368.16	1,800.00
应交税费		861.35	27.18

应付利息		3,873.88	-3,013.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	56,135.34	113,200.00
负债合计		19,117,662.06	9,066,142.27
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	48,351,002.01	56,883,532.27
未分配利润	6.4.7.10	10,788,885.66	11,584,656.82
所有者权益合计		59,139,887.67	68,468,189.09
负债和所有者权益总计		78,257,549.73	77,534,331.36

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 48,351,002.01 份，其中泰信鑫益定期开放 A 基金份额净值 1.226 元，份额总额 43,220,980.92 份；泰信鑫益定期开放 C 基金份额净值 1.200 元，份额总额 5,130,021.09 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,497,642.38	1,389,643.47
1.利息收入		1,040,542.09	714,231.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	33,887.03	27,481.22
债券利息收入		901,303.49	658,532.62
资产支持证券利息收入		7,405.28	-
买入返售金融资产收入		97,946.29	28,217.94
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		579,973.78	1,505,403.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	579,973.78	1,505,403.43
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-147,526.42	-831,024.33
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	24,652.93	1,032.59
减：二、费用		427,496.86	396,514.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	232,590.37	221,522.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	66,454.42	63,292.28
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	12,954.77	23,458.89
4. 交易费用	6.4.7.19	7,151.19	5,467.64
5. 利息支出		32,254.25	1,797.72
其中：卖出回购金融资产支出		32,254.25	1,797.72
6. 税金及附加		136.92	61.82
7. 其他费用	6.4.7.20	75,954.94	80,913.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,070,145.52	993,128.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,070,145.52	993,128.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	56,883,532.27	11,584,656.82	68,468,189.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,070,145.52	1,070,145.52
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）	-8,532,530.26	-1,865,916.68	-10,398,446.94
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-8,532,530.26	-1,865,916.68	-10,398,446.94
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）	48,351,002.01	10,788,885.66	59,139,887.67
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	44,038,136.40	6,924,925.01	50,963,061.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	993,128.70	993,128.70
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）	32,558,278.01	6,581,211.19	39,139,489.20
其中：1.基金申购款	33,871,650.42	6,833,655.74	40,705,306.16
2.基金赎回款	-1,313,372.41	-252,444.55	-1,565,816.96
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）	76,596,414.41	14,499,264.90	91,095,679.31

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：

<u>高宇</u>	<u>叶振宇</u>	<u>叶振宇</u>
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

泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]第 746 号《关于核准泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准，由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式

存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 232,623,276.88 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 426 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 7 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 232,641,999.64 份,其中认购资金利息折合 18,722.76 份。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金以定期开放的方式运作,以 1 年为一个运作周期每个运作周期为自基金合同生效日(包括该日)或每个自由开放期结束之后次日起(包括该日)至 1 年后的年度对日的前一日止。在每个运作周期结束后进入自由开放期。每个自由开放期最短不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日。在自由开放期间,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。本基金的每个运作周期以封闭期和受限开放期相交替的方式运作,共包含为 2 个封闭期和 1 个受限开放期。在首个运作周期中,本基金的受限开放期为基金合同生效日的半年度对日。在第二个及以后的运作周期中,本基金的受限开放期为该运作周期首日的半年度对日。本基金的每个受限开放期为 1 个工作日。在每个运作周期内,除受限开放期以外,均为封闭期。在封闭期内,本基金不接受基金份额的申购和赎回。

根据《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定本基金自募集期起根据申购费用及销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购/申购费,赎回时亦不收取赎回费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类两种收费模式并存,A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。因持有可转换债券转股所得的股票、因所持股票派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证,应当在其可上市交易后的 10 个交易日内卖出。本基金不主动参与二级市场买入股票或权证等权益类资产,也不主动参与一级市场新股的申购或增发。本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%,在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、每个自由开放期始前三个月至结束后三个月内不受前述比例限制。开放期内,基金持有现金或到期日

在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%。

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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期内无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 2021年6月30日
----	-------------------

活期存款	475,441.76
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：	475,441.76

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	15,329,791.64	15,392,630.00	62,838.36
	银行间市场	44,728,434.34	44,901,050.00	172,615.66
	合计	60,058,225.98	60,293,680.00	235,454.02
资产支持证券		5,014,667.13	5,003,000.00	-11,667.13
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		65,072,893.11	65,296,680.00	223,786.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	11,000,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	11,000,000.00	—

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	465.08
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	42.95
应收债券利息	1,237,104.93
应收资产支持证券利息	119,495.89
应收买入返售证券利息	20,821.92
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	4.50
合计	1,377,935.27

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	3,368.16
合计	3,368.16

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—

预提费用	56,135.34
合计	56,135.34

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰信鑫益定期开放 A		
项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,303,911.77	51,303,911.77
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	-8,082,930.85	-8,082,930.85
基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	43,220,980.92	43,220,980.92

金额单位：人民币元

泰信鑫益定期开放 C		
项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,579,620.50	5,579,620.50
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	-449,599.41	-449,599.41
基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	5,130,021.09	5,130,021.09

注：1、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。

2、根据《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金招募说明书》和《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2021 年 5 月 28 日(第八个受限开放日)开放申购、赎回业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰信鑫益定期开放 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,621,665.41	2,941,882.65	10,563,548.06
本期利润	1,109,898.44	-133,402.90	976,495.54
本期基金份额交易产生的变动数	-1,338,051.85	-440,192.94	-1,778,244.79
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,338,051.85	-440,192.94	-1,778,244.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,393,512.00	2,368,286.81	9,761,798.81

单位：人民币元

泰信鑫益定期开放 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	704,684.31	316,424.45	1,021,108.76
本期利润	107,773.50	-14,123.52	93,649.98
本期基金份额交易产生的变动数	-63,447.01	-24,224.88	-87,671.89
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-63,447.01	-24,224.88	-87,671.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	749,010.80	278,076.05	1,027,086.85

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	32,267.60
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	1,548.83
其他	70.60
合计	33,887.03

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	579,973.78
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	579,973.78

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	239,500,875.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	236,743,747.09
减：应收利息总额	2,177,154.33
买卖债券差价收入	579,973.78

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-147,526.42
——股票投资	-
——债券投资	-135,859.29
——资产支持证券投资	-11,667.13
——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	-147,526.42

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	24,652.93
合计	24,652.93

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

2. 本基金的转换费用由转出基金的赎回费、转出和转入基金的申购费补差构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,639.94
银行间市场交易费用	3,511.25
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	7,151.19

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	16,463.76
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,219.60
账户服务费	18,000.00
其他	600.00
合计	75,954.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

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

本报告期本基金控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
山东省国际信托股份有限公司（“山东国托”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司	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

本基金本报告期及上年度可比期间未进行关联交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	232,590.37	221,522.96
其中：支付销售机构的客户维护费	21,953.94	33,303.91

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 0.7% 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 × 0.7% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,454.42	63,292.28

注：支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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×0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信鑫益定期开放 A	泰信鑫益定期开放 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	104.42	104.42
中信银行	-	6,104.79	6,104.79
合计	-	6,209.21	6,209.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信鑫益定期开放 A	泰信鑫益定期开放 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	6,741.31	6,741.31
中信银行	-	9,652.28	9,652.28
合计	-	16,393.59	16,393.59

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 0.40% 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 级日基金托管费=前一日 C 级基金资产净值 x0.40%÷ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰信鑫益定期开放 A				
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山东省国际信 托股份有限公 司	21,426,377.64	44.31%	29,430,801.27	51.74%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	475,441.76	32,267.60	320,075.03	26,353.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 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

本基金本报告期内无利润分配的情况。

6.4.12 期末（2021 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**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 19,007,771.49 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210312	21 进出 12	2021 年 7 月 1 日	100.38	92,000	9,234,960.00
180211	18 国开 11	2021 年 7 月 1 日	101.76	106,000	10,786,560.00
合计				198,000	20,021,520.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险 and 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、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

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

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 24.84%（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 16.31%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 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 8.4596%。

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 2021 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 65,769,121.76 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	475,441.76	-	-	-	475,441.76
结算备付金	96,289.55	-	-	-	96,289.55
存出保证金	11,203.15	-	-	-	11,203.15
交易性金融资产	25,189,760.00	40,106,920.00	-	-	65,296,680.00
应收利息	-	-	-	1,377,935.27	1,377,935.27
其他资产	-	-	-	11,000,000.00	11,000,000.00
资产总计	25,772,694.46	40,106,920.00	-	12,377,935.27	78,257,549.73
负债					
卖出回购金融资产款	19,007,771.49	-	-	-	19,007,771.49
应付管理人报酬	-	-	-	33,936.45	33,936.45
应付托管费	-	-	-	9,696.13	9,696.13
应付销售服务费	-	-	-	2,019.26	2,019.26
应付交易费用	-	-	-	3,368.16	3,368.16
应付利息	-	-	-	3,873.88	3,873.88
应交税费	-	-	-	861.35	861.35
其他负债	-	-	-	56,135.34	56,135.34
负债总计	19,007,771.49	-	-	109,890.57	19,117,662.06
利率敏感度缺口	6,764,922.97	40,106,920.00	-	12,268,044.70	59,139,887.67
上年度末 2020 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	224,293.59	-	-	-	224,293.59
结算备付金	88,153.50	-	-	-	88,153.50
存出保证金	6,547.33	-	-	-	6,547.33
交易性金融资产	5,000,500.00	56,392,553.60	14,746,561.80	-	76,139,615.40
应收证券清算款	-	-	-	94,977.10	94,977.10

应收利息	-	-	-	980,744.44	980,744.44
资产总计	5,319,494.42	56,392,553.60	14,746,561.80	1,075,721.54	77,534,331.36
负债					
卖出回购金融资产款	8,900,000.00	-	-	-	8,900,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	40,370.21	40,370.21
应付托管费	-	-	-	11,534.34	11,534.34
应付销售服务费	-	-	-	2,224.28	2,224.28
应付交易费用	-	-	-	1,800.00	1,800.00
应付利息	-	-	-	-3,013.74	-3,013.74
应交税费	-	-	-	27.18	27.18
其他负债	-	-	-	113,200.00	113,200.00
负债总计	8,900,000.00	-	-	166,142.27	9,066,142.27
利率敏感度缺口	-3,580,505.58	56,392,553.60	14,746,561.80	909,579.27	68,468,189.09

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率上升 25 个基点	-190,082.34	-643,130.54
	2. 市场利率下降 25 个基点	191,872.83	660,429.27

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

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主

要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，且本期期末未持有股票，因此无重大市场价格风险。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	65,296,680.00	83.44
	其中：债券	60,293,680.00	77.05
	资产支持证券	5,003,000.00	6.39
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	11,000,000.00	14.06
	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	571,731.31	0.73
8	其他各项资产	1,389,138.42	1.78
9	合计	78,257,549.73	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末本基金未投资股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

报告期末本基金未投资股票。

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

截至报告期末本基金未投资股票。

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

截至报告期末本基金未投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

截至报告期末本基金未投资股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	701,120.00	1.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	44,901,050.00	75.92
	其中：政策性金融债	40,388,000.00	68.29
4	企业债券	14,026,800.00	23.72
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	664,710.00	1.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	60,293,680.00	101.95

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	180211	18 国开 11	200,000	20,352,000.00	34.41
2	210312	21 进出 12	100,000	10,038,000.00	16.97
3	200217	20 国开 17	100,000	9,998,000.00	16.91
4	163085	19 诚通 01	50,000	5,025,000.00	8.50
5	155154	19 渤海 01	50,000	5,011,000.00	8.47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	179335	璟悦 01 优	50,000	5,003,000.00	8.46

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国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本期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。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。

7.11.3 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	11,203.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,377,935.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,389,138.42

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123046	天铁转债	664,710.00	1.12

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未投资股票。

7.11.6 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
泰信鑫益定期开放 A	111	389,378.21	37,995,557.42	87.91%	5,225,423.50	12.09%
泰信鑫益定期开放 C	118	43,474.76	0.00	0.00%	5,130,021.09	100.00%
合计	229	211,139.75	37,995,557.42	78.58%	10,355,444.59	21.42%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰信鑫益定期开放 A	55,734.88	0.1290%
	泰信鑫益定期开放 C	97,325.49	1.8972%
	合计	153,060.37	0.3166%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	泰信鑫益定期开放 A	0
	泰信鑫益定期开放 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰信鑫益定期开放 A	0
	泰信鑫益定期开放 C	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	泰信鑫益定期开放 A	泰信鑫益定期开放 C
基金合同生效日（2013 年 7 月 17 日）基金份额总额	119,273,547.88	113,368,451.76
本报告期期初基金份额总额	51,303,911.77	5,579,620.50
本报告期基金总申购份额	—	—
减：本报告期基金总赎回份额	8,082,930.85	449,599.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	43,220,980.92	5,130,021.09

§ 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

1、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过,自 2021 年 1 月 21 日起,刘小舫女士担任公司督察长职务,高宇先生不再代任公司督察长职务。具体详情参见 2021 年 1 月 22 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关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

2、经泰信基金管理有限公司总办会审议通过,自 2021 年 6 月 9 日起,李俊江先生担任本基金基金经理,何俊春女士不再担任本基金基金经理。具体详情参见 2021 年 6 月 9 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关于泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金经理变更的公告》。本公司上述人事变动已按相关规定进行备案。

3、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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
海通证券	2	-	-	-	-	-

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、本基金新增交易单元: 无; 退租交易单元: 无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	251,063,615.47	100.00%	69,100,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	参加国金证券申购费率优惠	《证券日报》及规定网站	2021 年 1 月 19 日
2	2020 年 4 季度报告	《证券日报》及规定网站	2021 年 1 月 21 日
3	基金行业高级管理人员变更公告	《证券日报》及规定网站	2021 年 1 月 22 日
4	终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司和大泰金石基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务	《证券日报》及规定网站	2021 年 1 月 27 日
5	招募说明书更新、产品资料概要更新	《证券日报》及规定网站	2021 年 3 月 12 日
6	新增北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构并开通定投、转换业务及参加费率优惠活动的公告	《证券日报》及规定网站	2021 年 3 月 25 日
7	参与盈米基金转换费率优惠活动的公告	《证券日报》及规定网站	2021 年 3 月 25 日
8	2020 年年度报告	《证券日报》及规定网站	2021 年 3 月 29 日
9	新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并开通转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	《证券日报》及规定网站	2021 年 4 月 1 日
10	新增甬兴证券有限公司为销售机构并开通定投、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《证券日报》及规定网站	2021 年 4 月 1 日

11	新增中国中金财富证券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	《证券日报》及规定网站	2021 年 4 月 1 日
12	在济安财富、同花顺基金、天天基金、挖财基金、和耕传承的申购和赎回限额进行调整	《证券日报》及规定网站	2021 年 4 月 8 日
13	2021 年 1 季度报告	《证券日报》及规定网站	2021 年 4 月 20 日
14	开放申购、赎回业务公告（第八个受限开放日）	《证券日报》及规定网站	2021 年 5 月 18 日
15	参与宁波银行股份有限公司同业基金销售平台的销售业务并开通转换、定投业务及参加申购费率优惠活动的公告	《证券日报》及规定网站	2021 年 5 月 26 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	20210101 – 20210630	16,569,179.78	0.00	0.00	16,569,179.78	34.27%
	2	20210101 – 20210630	29,430,801.27	0.00	8,004,423.63	21,426,377.64	44.31%
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鑫益定期开放债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、报告期内本基金在规定媒介对外披露的各项公告

12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、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

2021 年 8 月 28 日