

泰信添瑞债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）起至 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	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	57

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	57
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.11 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信添瑞债券型证券投资基金	
基金简称	泰信添瑞债券	
基金主代码	016949	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 4 月 30 日	
基金管理人	泰信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	521,703,008.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰信添瑞债券 A	泰信添瑞债券 C
下属分级基金的交易代码	016949	026792
报告期末下属分级基金的份额总额	59,885,206.20 份	461,817,802.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，形成对各大类资产的预测和判断，并根据市场运行状况以及各类资产预期表现的相对变化，动态调整大类资产的配置比例，严格控制基金资产运作风险，提高基金资产风险调整后收益。本基金采取的投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、基金投资策略、回购策略、国债期货投资策略、信用衍生品投资策略、流动性管理策略等。
业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*15%+活期存款基准利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘小舫	方圆
	联系电话	021-20899003	95559
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-5988	95559
传真		021-20899008	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦	中国（上海）自由贸易试验区

	东南路 256 号 37 层	银城中路 188 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36-37 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	李高峰	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ftfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	泰信添瑞债券 A	泰信添瑞债券 C
本期已实现收益	407,362.64	3,507,488.83
本期利润	947,149.43	7,733,338.50
加权平均基金份额 本期利润	0.0097	0.0090
本期加权平均净 值利润率	0.97%	0.90%
本期基金份额净 值增长率	1.05%	1.01%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	404,133.17	2,964,436.26
期末可供分配基 金份额利润	0.0067	0.0064
期末基金资产净 值	60,511,623.12	466,495,840.77

期末基金份额净值	1.0105	1.0101
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1.05%	1.01%

- 注：1、本基金基金合同于 2026 年 4 月 30 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

泰信添瑞债券 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
自基金合同生效起至今	1.05%	0.26%	1.48%	0.26%	-0.43%	0.00%

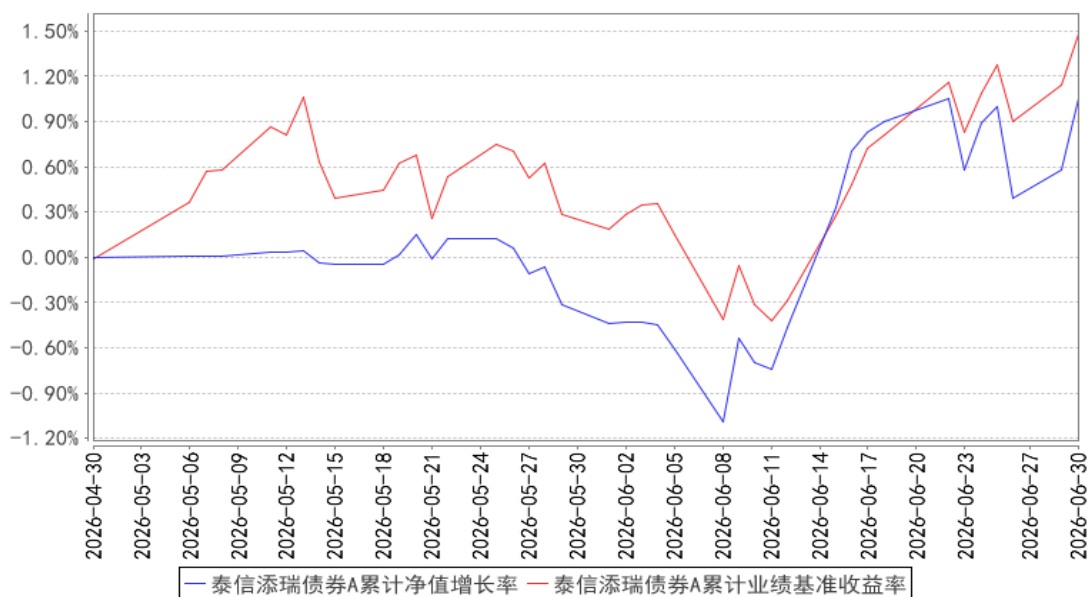
泰信添瑞债券 C

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
自基金合同生效起至今	1.01%	0.26%	1.48%	0.26%	-0.47%	0.00%

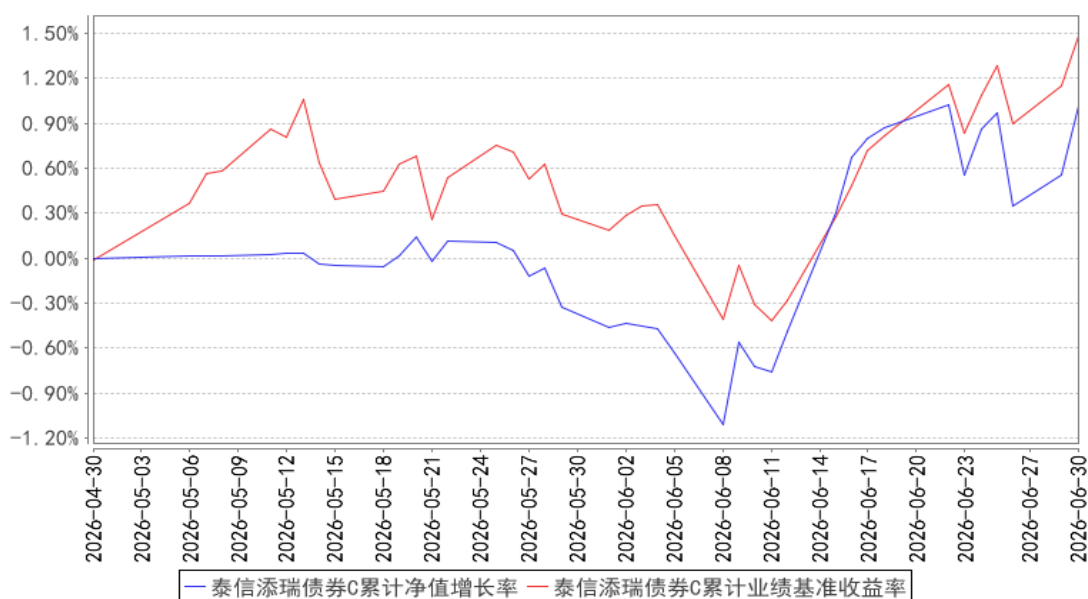
注：本基金的业绩比较基准为：中债-综合全价(总值)指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*15%+活期存款基准利率(税后)*5%

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

泰信添瑞债券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



泰信添瑞债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2026 年 4 月 30 日生效。截至本报告期末，本基金仍在建仓期。

2、本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）和可交换债券的投资比例合计不低于基金资产的 5%（其中，投资于境内股票资产（含 A 股股票型 ETF）的比例不低于基金资产的 5%），不超过基金资产的 20%。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的投资比例不超过基金资产净值的 10%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券

的投资比例不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

§ 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：张秉麟

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（现更名为青岛国信产融控股（集团）有限公司）共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是“好人举手”制度下，获准筹建的第一家以信托公司为主发起人的基金管理公司。2021 年 9 月 2 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]2848 号文核准，山东省国际信托股份有限公司将其持有的 45%股权转让给山东省鲁信投资控股集团有限公司。目前，公司注册资本为 2 亿元人民币，股东为山东省鲁信投资控股集团有限公司、江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信产融控股（集团）有限公司。截至 2026 年 6 月末，泰信基金管理有限公司旗下管理共计 40 只开放式基金及多个资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张海涛	泰信中证 200 指数	2026 年 4 月 30 日	-	6 年	张海涛先生，研究生学历。曾任华夏基金管理有限公司资产配置部研究员，北京源

证券投资基金基金经理、泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理、泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理、泰信智选量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理、泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金基金经理、泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理、泰信添瑞债券型证券投资基金基金经理。				峰私募基金管理合伙企业（有限合伙）研究部研究员。2024 年 9 月加入泰信基金管理有限公司，曾任基金经理助理兼研究员，2025 年 1 月任泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理，2025 年 1 月任泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 1 月任泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理，2025 年 1 月任泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 6 月任泰信智选量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 10 月任泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月任泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金基金经理，2026 年 1 月任上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理，2026 年 4 月任泰信添瑞债券型证券投资基金基金经理。
---	--	--	--	---

	券型证券投资基金基金经理				
张安格	泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理、泰信添利30天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理、泰信汇鑫三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理、泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金经理、泰信添瑞债券型证券投资基金基金经理	2026 年 4 月 30 日	-	11 年	张安格女士，研究生学历。曾任职于申万宏源证券有限公司资产管理事业部，从事固定收益类产品的设计、交易、研究及投资。2020 年 12 月加入泰信基金管理有限公司拟任基金经理。2021 年 2 月任泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至 2023 年 11 月任泰信汇享利率债债券型证券投资基金基金经理，2022 年 3 月任泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 3 月至 2025 年 10 月任泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 3 月至 2025 年 11 月任泰信汇盈债券型证券投资基金基金经理，2022 年 10 月任泰信汇鑫三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2024 年 7 月任泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理，2024 年 7 月任泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2026 年 4 月任泰信添瑞债券型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期、离任日期分别指根据基金管理人决定确定的聘任日期和解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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》、《泰信添瑞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

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》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易部集中执行，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，投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济运行平稳，第一、第二季度 GDP 增速分别录得 5.0% 和 4.3%。从结构上看，出口保持高增，消费小幅增长，固定资产投资增速转负，经济增长主要依靠外需带动。价格方面，PPI 与 CPI 增速差逐渐拉大，表明上下游企业利润存在 K 型分化。另一方面，以算力产业链为代表的科技成长型企业维持较高的营收和利润增速，成为驱动经济活力的重要力量。

上半年债券市场收益率震荡下行，波动率呈逐步收敛的状态。中短端债券受益于资金面宽松的利好，在上涨过程中回撤较小，整体的持有体验较好，其中中短久期信用债更是享受了信用利

差压缩的超额收益。而超长期利率债则更考验投资者的交易能力，在前四个月波动较大，近期波动率则显著降低。

2026 年上半年，A 股市场呈现“指数繁荣、结构剧烈分化”的特征。主要指数震荡上行，市场交投活跃，半年度总成交额创历史新高。收益高度集中于科技成长板块，AI 科技成为贯穿上半年的核心主线，半导体、光通信等硬件端强势领涨，相关行业指数涨幅显著领先；而大消费、商贸零售、地产链等传统板块持续承压。资金结构方面，大盘龙头股优势持续强化，中小市值品种则整体表现偏弱。总体而言，2026 年上半年 A 股市场科技成长大幅领跑，结构性牛市特征突出。这一格局深刻反映了宏观经济转型与新质生产力政策导向的叠加影响。

股票投资上，本基金依托量化多因子模型开展投资决策，全市场优选个股，同时适度保持分散和行业均衡。债券投资方面则在基金成立后开始逐步建仓，目前以中短久期信用债及利率债持仓为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信添瑞债券 A 基金份额净值为 1.0105 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.05%;截止本报告期末泰信添瑞债券 C 基金份额净值为 1.0101 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.01%;同期业绩比较基准收益率为 1.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，宏观经济有望延续平稳运行与温和修复态势，国内流动性环境整体保持充裕，权益市场核心驱动力将逐步由估值扩张切换至盈利兑现，行情或从明显分化走向再平衡。

债券市场则可能会在一段时间内维持窄幅震荡的格局，主要原因在于经济基本面和资金利率在短期内会相对平稳，出现超预期变化的可能性较低。债券市场的波动，更多可能是受债券供需平衡的影响，但此类影响相对可控。一方面，债市供给较大时，央行更倾向于维持较为宽松的资金面以支持债券市场的稳定运行；另一方面，需求端在风险偏好不发生显著改变的情况下，具有较强的自我调节能力，可在一定程度上平抑市场的波动。从内部结构来看，未来一段时间债市的超额收益可能会来自超长利率债，期限利差是当前债市为数不多具有博弈空间的地方。信用债方面，需逐步提高对信用风险的识别，防范少数主体的信用利差扩张的风险。

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、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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，投资者可选择现金红利或将现金红利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；

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各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。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

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

本报告期内，基金托管人在泰信添瑞债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，泰信基金管理有限公司在泰信添瑞债券型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由泰信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泰信添瑞债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信添瑞债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	6,027,707.77
结算备付金		11,369,552.32
存出保证金		29,756.06
交易性金融资产	6.4.7.2	470,251,040.21
其中：股票投资		101,133,528.99
基金投资		-
债券投资		369,117,511.22
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	40,001,753.42
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		7,096,991.99
应收股利		-
应收申购款		1,605,632.62
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		536,382,434.39
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
负 债：		

短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		8,418,521.74
应付管理人报酬		418,488.48
应付托管费		69,748.06
应付销售服务费		125,154.76
应付投资顾问费		-
应交税费		32,757.42
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	310,300.04
负债合计		9,374,970.50
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	521,703,008.42
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	5,304,455.47
净资产合计		527,007,463.89
负债和净资产总计		536,382,434.39

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间，无上年度末可比数据。

2、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 521,703,008.42 份。其中：泰信添瑞债券 A 份额净值人民币 1.0105 元，基金份额总额 59,885,206.20 份；泰信添瑞债券 C 份额净值人民币 1.0101 元，基金份额总额 461,817,802.22 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信添瑞债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 4 月 30 日（基金合 同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		10,116,141.85
1. 利息收入		1,271,952.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	605,331.97
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		666,620.48

其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,078,552.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,604,175.72
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	904,302.49
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	570,074.73
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,765,636.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、营业总支出		1,435,653.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	955,102.24
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	159,183.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	285,813.43
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		548.49
其中：卖出回购金融资产支出		548.49
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		3,882.79
8. 其他费用	6.4.7.19	31,123.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,680,487.93
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,680,487.93
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		8,680,487.93

注：本基金合同生效日为 2026 年 4 月 30 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：泰信添瑞债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,053,143,055.53	-	-	1,053,143,055.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-531,440,047.11	-	5,304,455.47	-526,135,591.64
（一）、综合收益总额	-	-	8,680,487.93	8,680,487.93
（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）	-531,440,047.11	-	-3,376,032.46	-534,816,079.57
其中：1. 基金申购款	12,948,998.71	-	68,380.89	13,017,379.60
2. 基金赎回款	-544,389,045.82	-	-3,444,413.35	-547,833,459.17
（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	521,703,008.42	-	5,304,455.47	527,007,463.89

注：本基金合同生效日为 2026 年 4 月 30 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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>李高峰</u>	<u>段晓旭</u>	<u>顾颖</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

泰信添瑞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[2025]第 3009 号《关于准予泰信添瑞债券型证券投资基金注册的批复》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《泰信添瑞债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 1,053,143,055.53 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(26)第 00157 号验资报告。《泰信添瑞债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2026 年 4 月 30 日正式生效。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信添瑞债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市交易的股票(包括主板、科创板、创业板以及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、债券回购、现金等货币市场工具、信用衍生品、国债期货、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(仅包括全市场股票型 ETF 及本基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金,不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的基金中基金、货币市场基金)等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%;股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)和可交换债券的投资比例合计不低于基金资产的 5%(其中,投资于境内股票资产(含 A 股股票型 ETF)的比例不低于基金资产的 5%),不超过基金资产的 20%。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的投资比例不超过基金资产净值的 10%。本基金每个交易

日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为中债-综合全价(总值)指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*15%+活期存款基准利率(税后)*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、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。

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 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。

6.4.4 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。

本基金在前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，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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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，投资者可选择现金红利或将现金红利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；

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各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日上海证券交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1)自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金(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。

2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3)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。

4)对基金取得的股票股息红利所得，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。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。

5)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。

6)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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	6,027,707.77
等于：本金	6,020,662.18
加：应计利息	7,045.59
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	6,027,707.77

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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		96,047,674.99	-	101,133,528.99	5,085,854.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	19,983,300.00	38,915.07	20,032,915.07	10,700.00
	银行间市场	342,896,917.54	6,518,596.15	349,084,596.15	-330,917.54
	合计	362,880,217.54	6,557,511.22	369,117,511.22	-320,217.54
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		458,927,892.53	6,557,511.22	470,251,040.21	4,765,636.46

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 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	—	—
银行间市场	40,001,753.42	—
合计	40,001,753.42	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	—
应付交易费用	279,576.74
其中：交易所市场	265,444.74
银行间市场	14,132.00
应付利息	—
预提费用	30,723.30
合计	310,300.04

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

泰信添瑞债券 A

项目	本期 2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	107,222,518.98	107,222,518.98
本期申购	1,298,650.17	1,298,650.17
本期赎回（以“-”号填列）	-48,635,962.95	-48,635,962.95
基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算调整	—	—
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	59,885,206.20	59,885,206.20

泰信添瑞债券 C

项目	本期	
	2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	945,920,536.55	945,920,536.55
本期申购	11,650,348.54	11,650,348.54
本期赎回（以“-”号填列）	-495,753,082.87	-495,753,082.87
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	461,817,802.22	461,817,802.22

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、本基金自 2026 年 4 月 13 日至 2026 年 4 月 28 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 1,052,989,636.84 元，折合为 1,052,989,636.84 份基金份额（其中 A 类基金份额 107,204,281.14 份，C 类基金份额 945,785,355.70 份）。根据《泰信添瑞债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 153,418.69 元在本基金成立后，折合为 153,418.69 份基金份额（其中 A 类基金份额 18,237.84 份，C 类基金份额 135,180.85 份），划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

泰信添瑞债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	407,362.64	539,786.79	947,149.43
本期基金份额交易产生的变动数	-3,229.47	-317,503.04	-320,732.51
其中：基金申购款	-322.52	8,116.23	7,793.71
基金赎回款	-2,906.95	-325,619.27	-328,526.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	404,133.17	222,283.75	626,416.92

泰信添瑞债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,507,488.83	4,225,849.67	7,733,338.50
本期基金份额交易产生的变动数	-543,052.57	-2,512,247.38	-3,055,299.95
其中：基金申购款	48,727.78	11,859.40	60,587.18
基金赎回款	-591,780.35	-2,524,106.78	-3,115,887.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,964,436.26	1,713,602.29	4,678,038.55

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	602,892.41
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	2,431.54
其他	8.02
合计	605,331.97

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,604,175.72
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	2,604,175.72

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	251,144,300.52
减：卖出股票成本总额	248,110,938.52
减：交易费用	429,186.28

买卖股票差价收入	2,604,175.72
----------	--------------

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,250,424.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-346,122.04
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	904,302.49

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	244,424,902.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	241,524,947.11
减：应计利息总额	3,237,277.80
减：交易费用	8,800.00
买卖债券差价收入	-346,122.04

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	570,074.73
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	570,074.73

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,765,636.46
股票投资	5,085,854.00
债券投资	-320,217.54
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	4,765,636.46

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	2,520.30
信息披露费	25,203.00
证券出借违约金	-
账户维护费	3,000.00
其他	400.00
合计	31,123.30

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、关联关系

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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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
青岛国信产融控股(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	955,102.24
其中：应支付销售机构的客户维护	453,854.56

费	
应支付基金管理人的净管理费	501,247.68

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的基金所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）×0.60%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=前一日的基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的基金所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）×0.60%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
	日
当期发生的基金应支付的托管费	159,183.67

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的基金所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）×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：

日基金托管费=前一日的基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的基金所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）×0.10%÷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 2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信添瑞债券 A	泰信添瑞债券 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	3.21	3.21
交通银行	-	53,359.82	53,359.82
合计	-	53,363.03	53,363.03

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 类基金份额销售服务费费率为 0.20%。其计算公式为：

C 类日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.20%÷当年天数。

投资者通过直销机构认购、申购的 C 类基金份额不收取销售服务费。投资者通过直销机构以外的其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年（即 365 天，下同）的 C 类基金份额，将不

再继续收取销售服务费。本基金 C 类基金份额具体的销售服务费将按以下方式确认：

（1）基金管理人直销机构：

对于 C 类基金份额计提的销售服务费，在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时，随赎回款(或清算款)一并返还给投资者。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

（2）基金管理人直销机构以外的其他销售机构：

对于投资者持续持有期限未超过一年(即 365 天，下同)的 C 类基金份额收取的销售服务费，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月月初 5 个工作日内从基金财产中一次性付给各销售机构，或一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。

对于持续持有期限超过一年的 C 类基金份额继续计提的销售服务费，在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时，随赎回款(或清算款)一并返还给投资者。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内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

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	6, 027, 707. 77	602, 892. 41

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

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（2026 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	2,600	1,399,050.41	2,163,200.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是债券型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括债券投资、资产支持证券投资、货币资金等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，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(审计部)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交通银行，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。附注 6.4.13.2.1 至附注 6.4.13.2.6 列示了于本报告期末及上年度末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	20,030,389.04
合计	20,030,389.04

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出，未评级债券列示短期融资券和超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
AAA	308,928,092.04
AAA 以下	-
未评级	-

合计	308,928,092.04
----	----------------

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.4105%。

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 2026 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为人民币 507,835,094.04 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,027,707.77	-	-	-	6,027,707.77
结算备付金	11,369,552.32	-	-	-	11,369,552.32
存出保证金	29,756.06	-	-	-	29,756.06
交易性金融资产	369,117,511.22	-	-	101,133,528.99	470,251,040.21
买入返售金融资产	40,001,753.42	-	-	-	40,001,753.42
应收申购款	-	-	-	1,605,632.62	1,605,632.62

应收清算款	-	-	-	7,096,991.99	7,096,991.99
资产总计	426,546,280.79	-	-	109,836,153.60	536,382,434.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,418,521.74	8,418,521.74
应付管理人报酬	-	-	-	418,488.48	418,488.48
应付托管费	-	-	-	69,748.06	69,748.06
应付销售服务费	-	-	-	125,154.76	125,154.76
应交税费	-	-	-	32,757.42	32,757.42
其他负债	-	-	-	310,300.04	310,300.04
负债总计	-	-	-	9,374,970.50	9,374,970.50
利率敏感度缺口	426,546,280.79	-	-	100,461,183.10	527,007,463.89

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2026年6月30日）
	1. 市场利率上升25个基点	-2,076,168.43
	2. 市场利率下降25个基点	2,240,613.45

6.4.13.4.2 其他价格风险

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

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	101,133,528.99	19.19

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	101,133,528.99	19.19

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5%，其他变量不变	
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（2026 年 6 月 30 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	5,528,991.08
	2. 业绩比较基准下降 5%	-5,528,991.08

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	98,970,328.99
第二层次	371,280,711.22
第三层次	－

合计	470,251,040.21
----	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	101,133,528.99	18.85
	其中：股票	101,133,528.99	18.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	369,117,511.22	68.82
	其中：债券	369,117,511.22	68.82
	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	40,001,753.42	7.46
	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	17,397,260.09	3.24
8	其他各项资产	8,732,380.67	1.63
9	合计	536,382,434.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	200,540.00	0.04
B	采矿业	3,708,026.00	0.70
C	制造业	76,739,206.56	14.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,184,568.00	0.41
E	建筑业	196,143.00	0.04
F	批发和零售业	1,472,233.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	1,501,575.00	0.28
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,791,643.43	1.29
J	金融业	5,257,711.00	1.00
K	房地产业	503,106.00	0.10
L	租赁和商务服务业	936,760.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	436,495.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	518,204.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	305,070.00	0.06
Q	卫生和社会工作	254,112.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	128,136.00	0.02
S	综合	—	—
	合计	101,133,528.99	19.19

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688072	拓荆科技	2,600	2,163,200.00	0.41
2	001309	德明利	1,400	1,320,060.00	0.25
3	300604	长川科技	3,800	1,297,396.00	0.25
4	688498	源杰科技	603	1,137,258.00	0.22
5	300857	协创数据	3,300	1,121,670.00	0.21
6	002281	光迅科技	4,300	1,104,842.00	0.21
7	688347	华虹宏力	2,735	919,780.50	0.17

8	002436	兴森科技	18,000	917,100.00	0.17
9	688120	华海清科	2,768	891,794.24	0.17
10	002008	大族激光	5,900	885,649.00	0.17
11	300136	信维通信	7,300	870,525.00	0.17
12	300475	香农芯创	2,500	750,000.00	0.14
13	688361	中科飞测	1,621	697,030.00	0.13
14	300757	罗博特科	1,100	680,900.00	0.13
15	300223	北京君正	2,600	647,140.00	0.12
16	300054	鼎龙股份	6,000	635,820.00	0.12
17	688200	华峰测控	1,200	630,120.00	0.12
18	600105	永鼎股份	9,300	627,564.00	0.12
19	300666	江丰电子	1,700	626,620.00	0.12
20	688002	睿创微纳	3,865	597,876.85	0.11
21	688017	绿的谐波	1,400	585,004.00	0.11
22	002851	麦格米特	3,400	568,412.00	0.11
23	300395	菲利华	4,200	561,666.00	0.11
24	300285	国瓷材料	5,300	546,854.00	0.10
25	601869	长飞光纤	1,000	545,900.00	0.10
26	688019	安集科技	1,600	543,136.00	0.10
27	300570	太辰光	2,100	518,091.00	0.10
28	000960	锡业股份	11,900	508,011.00	0.10
29	688777	中控技术	4,262	500,785.00	0.10
30	600988	赤峰黄金	18,200	479,024.00	0.09
31	001389	广合科技	2,000	474,500.00	0.09
32	688099	晶晨股份	4,551	468,297.90	0.09
33	002273	水晶光电	13,100	464,788.00	0.09
34	600885	宏发股份	13,400	462,166.00	0.09
35	600498	烽火通信	6,200	456,320.00	0.09
36	300620	光库科技	1,200	453,840.00	0.09
37	600879	航天电子	21,200	451,348.00	0.09
38	601179	中国西电	30,100	449,092.00	0.09
39	300548	长芯博创	1,600	444,800.00	0.08
40	688037	芯源微	1,012	444,318.60	0.08
41	300390	天华新能	4,700	439,497.00	0.08
42	002738	中矿资源	7,400	436,526.00	0.08
43	300346	南大光电	4,700	435,455.00	0.08
44	002409	雅克科技	1,900	426,550.00	0.08
45	688313	仕佳光子	2,288	422,479.20	0.08
46	688220	翱捷科技	3,394	421,942.08	0.08
47	300567	精测电子	1,300	412,880.00	0.08
48	002185	华天科技	18,500	412,735.00	0.08
49	300373	扬杰科技	2,600	408,798.00	0.08
50	300037	新宙邦	4,400	408,540.00	0.08

51	601108	财通证券	46,600	403,090.00	0.08
52	301377	鼎泰高科	700	385,630.00	0.07
53	688578	艾力斯	3,479	379,906.80	0.07
54	002203	海亮股份	16,600	379,310.00	0.07
55	002850	科达利	2,000	378,600.00	0.07
56	301526	国际复材	8,100	378,027.00	0.07
57	300058	蓝色光标	27,300	375,648.00	0.07
58	002821	凯莱英	2,300	372,600.00	0.07
59	688469	芯联集成	35,061	371,997.21	0.07
60	002966	苏州银行	53,400	371,664.00	0.07
61	688702	盛科通信	935	364,640.65	0.07
62	688172	燕东微	4,355	364,339.30	0.07
63	603659	璞泰来	12,400	358,732.00	0.07
64	688235	百济神州	1,400	356,454.00	0.07
65	688385	复旦微电	4,897	349,107.13	0.07
66	601555	东吴证券	43,700	346,104.00	0.07
67	002195	岩山科技	52,500	343,350.00	0.07
68	600601	方正科技	24,600	340,464.00	0.06
69	605589	圣泉集团	5,300	336,921.00	0.06
70	301536	星辰科技	2,600	334,646.00	0.06
71	600563	法拉电子	1,700	324,360.00	0.06
72	000831	中国稀土	5,800	321,842.00	0.06
73	002797	第一创业	48,600	319,302.00	0.06
74	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.06
75	002126	银轮股份	6,300	313,740.00	0.06
76	688234	天岳先进	1,800	312,318.00	0.06
77	300751	迈为股份	1,100	310,706.00	0.06
78	688027	国盾量子	600	302,406.00	0.06
79	600392	盛和资源	10,000	297,700.00	0.06
80	688301	奕瑞科技	2,400	297,600.00	0.06
81	600109	国金证券	33,400	293,252.00	0.06
82	688411	海博思创	1,000	291,200.00	0.06
83	688052	纳芯微	1,000	288,310.00	0.05
84	002402	和而泰	10,900	281,547.00	0.05
85	603129	春风动力	1,100	281,380.00	0.05
86	002812	恩捷股份	4,200	281,022.00	0.05
87	301358	湖南裕能	3,700	280,719.00	0.05
88	002444	巨星科技	9,000	279,900.00	0.05
89	688599	天合光能	19,716	278,389.92	0.05
90	601162	天风证券	82,500	278,025.00	0.05
91	688169	石头科技	2,898	275,223.06	0.05
92	300677	英科医疗	6,900	270,273.00	0.05
93	601665	齐鲁银行	46,700	269,459.00	0.05

94	002335	科华数据	6,300	267,435.00	0.05
95	002465	海格通信	20,800	265,616.00	0.05
96	002414	高德红外	20,000	265,200.00	0.05
97	605358	立昂微	3,400	263,840.00	0.05
98	601233	桐昆股份	12,100	261,965.00	0.05
99	002261	拓维信息	9,300	260,493.00	0.05
100	600378	昊华科技	3,400	256,292.00	0.05
101	603688	石英股份	3,100	256,091.00	0.05
102	300953	震裕科技	1,900	254,030.00	0.05
103	603806	福斯特	15,100	253,529.00	0.05
104	002415	海康威视	7,300	249,660.00	0.05
105	600367	红星发展	3,900	245,427.00	0.05
106	600711	盛屯矿业	22,300	244,631.00	0.05
107	300699	光威复材	8,400	240,660.00	0.05
108	300454	深信服	2,500	240,500.00	0.05
109	600909	华安证券	21,400	237,754.00	0.05
110	003031	中瓷电子	1,300	234,390.00	0.04
111	300843	胜蓝股份	1,500	234,375.00	0.04
112	002340	格林美	35,100	232,011.00	0.04
113	002131	利欧股份	48,500	230,375.00	0.04
114	600497	驰宏锌锗	19,000	230,090.00	0.04
115	002065	东华软件	32,100	229,194.00	0.04
116	600536	中国软件	8,100	227,772.00	0.04
117	605117	德业股份	2,140	227,225.20	0.04
118	600143	金发科技	14,600	225,570.00	0.04
119	600157	永泰能源	139,700	224,917.00	0.04
120	688668	鼎通科技	600	223,980.00	0.04
121	603766	隆鑫通用	18,600	221,898.00	0.04
122	300017	网宿科技	17,000	221,170.00	0.04
123	601699	潞安环能	15,400	219,912.00	0.04
124	300919	中伟新材	5,000	218,750.00	0.04
125	002841	视源股份	6,300	217,539.00	0.04
126	000415	渤海租赁	53,400	217,338.00	0.04
127	000683	博源化工	37,700	217,152.00	0.04
128	601991	大唐发电	30,600	216,648.00	0.04
129	603699	纽威股份	4,300	216,290.00	0.04
130	600141	兴发集团	4,600	216,062.00	0.04
131	301511	德福科技	1,500	215,775.00	0.04
132	688213	思特威	2,000	214,140.00	0.04
133	688531	日联科技	1,200	213,408.00	0.04
134	600118	中国卫星	2,600	213,330.00	0.04
135	600546	山煤国际	19,500	213,135.00	0.04
136	600637	东方明珠	25,400	211,074.00	0.04

137	002384	东山精密	800	209,880.00	0.04
138	603345	安井食品	2,600	208,494.00	0.04
139	605588	冠石科技	3,100	208,227.00	0.04
140	600183	生益科技	1,200	208,080.00	0.04
141	688359	三孚新科	1,045	207,369.80	0.04
142	300547	川环科技	6,200	207,018.00	0.04
143	603990	麦迪科技	9,700	206,513.00	0.04
144	600233	圆通速递	13,100	206,325.00	0.04
145	002255	海陆重工	21,000	206,220.00	0.04
146	601212	白银有色	40,500	205,740.00	0.04
147	688061	灿瑞科技	4,135	205,385.45	0.04
148	002317	众生药业	8,300	203,931.00	0.04
149	002768	国恩股份	3,900	203,034.00	0.04
150	600486	扬农化工	4,000	202,800.00	0.04
151	603931	格林达	3,400	201,960.00	0.04
152	600642	申能股份	23,100	201,663.00	0.04
153	002202	金风科技	8,400	200,760.00	0.04
154	301031	中熔电气	1,672	199,720.40	0.04
155	300518	新迅达	6,000	198,300.00	0.04
156	688045	必易微	2,453	198,153.34	0.04
157	600312	平高电气	11,200	197,792.00	0.04
158	688778	厦钨新能	3,629	197,417.60	0.04
159	001339	智微智能	1,930	197,400.40	0.04
160	688253	英诺特	3,269	197,055.32	0.04
161	600487	亨通光电	1,800	196,812.00	0.04
162	000893	亚钾国际	4,800	196,272.00	0.04
163	603063	禾望电气	3,700	195,693.00	0.04
164	000887	中鼎股份	10,900	195,001.00	0.04
165	002517	恺英网络	11,900	193,375.00	0.04
166	601001	晋控煤业	11,100	193,029.00	0.04
167	300339	润和软件	5,000	192,550.00	0.04
168	300959	线上线下	1,300	192,153.00	0.04
169	603567	珍宝岛	43,800	191,844.00	0.04
170	300207	欣旺达	10,100	191,799.00	0.04
171	002120	韵达股份	30,100	191,436.00	0.04
172	300432	富临精工	9,500	190,855.00	0.04
173	601799	星宇股份	2,100	190,302.00	0.04
174	600763	通策医疗	5,600	189,728.00	0.04
175	600985	淮北矿业	13,500	189,675.00	0.04
176	600583	海油工程	37,400	188,122.00	0.04
177	300069	金利华电	5,900	187,797.00	0.04
178	600352	浙江龙盛	15,500	187,705.00	0.04
179	001259	利仁科技	2,800	187,516.00	0.04

180	603087	甘李药业	3,300	187,308.00	0.04
181	603800	洪田股份	2,300	186,967.00	0.04
182	688676	金盘科技	2,200	186,208.00	0.04
183	002971	和远气体	3,000	186,000.00	0.04
184	601577	长沙银行	21,300	185,523.00	0.04
185	688617	惠泰医疗	1,021	185,372.76	0.04
186	000603	盛达资源	8,000	184,800.00	0.04
187	603150	万朗磁塑	2,600	184,080.00	0.03
188	000975	山金国际	10,800	183,600.00	0.03
189	600704	物产中大	38,800	183,136.00	0.03
190	002353	杰瑞股份	1,200	183,000.00	0.03
191	688322	奥比中光	1,400	182,770.00	0.03
192	600958	东方证券	19,300	182,192.00	0.03
193	601399	国机重装	51,900	181,650.00	0.03
194	688122	西部超导	2,890	181,520.90	0.03
195	603308	应流股份	3,000	181,200.00	0.03
196	000636	风华高科	2,500	180,600.00	0.03
197	605318	法狮龙	1,600	180,576.00	0.03
198	301200	大族数控	500	180,325.00	0.03
199	601111	中国国航	29,800	180,290.00	0.03
200	300478	杭州高新	4,900	179,781.00	0.03
201	002429	兆驰股份	17,300	179,747.00	0.03
202	603317	天味食品	13,800	179,538.00	0.03
203	603160	汇顶科技	2,900	178,959.00	0.03
204	603016	新宏泰	5,300	178,928.00	0.03
205	002683	广东宏大	6,100	178,669.00	0.03
206	000783	长江证券	18,300	178,425.00	0.03
207	300001	特锐德	4,700	177,801.00	0.03
208	002595	豪迈科技	3,800	177,080.00	0.03
209	600901	江苏金租	30,700	176,525.00	0.03
210	603779	威龙股份	23,500	176,485.00	0.03
211	603065	宿迁联盛	8,700	176,262.00	0.03
212	600329	达仁堂	4,700	174,934.00	0.03
213	000878	云南铜业	10,900	173,092.00	0.03
214	000967	盈峰环境	16,400	172,692.00	0.03
215	603538	美诺华	5,300	172,515.00	0.03
216	301186	超达装备	4,200	172,200.00	0.03
217	301280	珠城科技	3,400	171,938.00	0.03
218	000338	潍柴动力	6,300	171,675.00	0.03
219	001360	南矿集团	9,700	171,593.00	0.03
220	601985	中国核电	19,000	171,570.00	0.03
221	002283	天润工业	17,700	170,805.00	0.03
222	601126	四方股份	2,700	170,640.00	0.03

223	001376	百通能源	16,400	170,560.00	0.03
224	605222	起帆电缆	7,300	170,236.00	0.03
225	002472	双环传动	4,100	170,191.00	0.03
226	000933	神火股份	8,000	169,600.00	0.03
227	600816	建元信托	69,400	169,336.00	0.03
228	601958	金钼股份	6,000	168,660.00	0.03
229	600483	福能股份	16,500	168,135.00	0.03
230	601615	明阳智能	14,500	167,765.00	0.03
231	601990	南京证券	25,500	167,535.00	0.03
232	688166	博瑞医药	4,728	165,527.28	0.03
233	603939	益丰药房	9,200	165,416.00	0.03
234	600887	伊利股份	6,900	165,324.00	0.03
235	002155	湖南黄金	6,900	164,703.00	0.03
236	600683	京投发展	14,300	164,450.00	0.03
237	603737	三棵树	6,800	163,880.00	0.03
238	601598	中国外运	33,000	163,680.00	0.03
239	600025	华能水电	18,400	163,576.00	0.03
240	002831	裕同科技	4,600	163,576.00	0.03
241	002969	嘉美包装	11,600	163,328.00	0.03
242	300649	杭州园林	5,800	162,342.00	0.03
243	301611	珂玛科技	900	162,063.00	0.03
244	002838	道恩股份	5,200	159,224.00	0.03
245	300759	康龙化成	5,500	159,115.00	0.03
246	300492	华图山鼎	4,600	158,010.00	0.03
247	601099	太平洋	46,800	157,716.00	0.03
248	002392	北京利尔	19,500	157,365.00	0.03
249	000155	川能动力	13,100	156,938.00	0.03
250	300115	长盈精密	5,600	156,464.00	0.03
251	688331	荣昌生物	1,200	156,312.00	0.03
252	000932	华菱钢铁	44,900	155,803.00	0.03
253	688709	成都华微	4,080	155,407.20	0.03
254	600566	济川药业	7,000	155,330.00	0.03
255	002601	龙佰集团	9,400	154,912.00	0.03
256	300255	常山药业	6,600	154,572.00	0.03
257	002757	南兴股份	8,500	153,425.00	0.03
258	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.03
259	688319	欧林生物	3,481	153,094.38	0.03
260	600282	南钢股份	33,200	152,388.00	0.03
261	600808	马钢股份	60,900	152,250.00	0.03
262	300536	农尚环境	17,700	150,273.00	0.03
263	688719	爱科赛博	1,951	150,227.00	0.03
264	002410	广联达	18,400	150,144.00	0.03
265	603179	新泉股份	3,000	148,950.00	0.03

266	002338	奥普光电	2,600	148,720.00	0.03
267	002007	华兰生物	12,200	148,718.00	0.03
268	002432	九安医疗	2,100	148,428.00	0.03
269	300957	贝泰妮	4,700	148,097.00	0.03
270	600685	中船防务	5,800	147,552.00	0.03
271	002913	奥士康	2,300	147,062.00	0.03
272	002607	中公教育	81,700	147,060.00	0.03
273	000034	神州数码	5,240	145,410.00	0.03
274	002271	东方雨虹	12,200	144,814.00	0.03
275	688112	鼎阳科技	1,956	143,687.76	0.03
276	300383	光环新网	11,500	143,060.00	0.03
277	603156	养元饮品	2,900	142,303.00	0.03
278	600884	杉杉股份	10,500	142,275.00	0.03
279	600021	上海电力	9,400	141,658.00	0.03
280	601198	东兴证券	10,400	141,336.00	0.03
281	603233	大参林	9,400	141,282.00	0.03
282	688363	华熙生物	3,945	141,112.65	0.03
283	688180	君实生物	4,091	138,357.62	0.03
284	603228	景旺电子	1,900	137,579.00	0.03
285	600115	中国东航	36,000	137,160.00	0.03
286	000570	苏常柴 A	29,300	136,831.00	0.03
287	600967	内蒙一机	12,600	136,710.00	0.03
288	603658	安图生物	4,700	136,394.00	0.03
289	601225	陕西煤业	6,700	136,345.00	0.03
290	300496	中科创达	2,200	135,938.00	0.03
291	603979	金诚信	2,300	135,769.00	0.03
292	002130	沃尔核材	7,100	134,616.00	0.03
293	300458	全志科技	3,400	134,164.00	0.03
294	002266	浙富控股	26,500	134,090.00	0.03
295	688387	信科移动	6,728	133,483.52	0.03
296	603565	中谷物流	13,600	133,416.00	0.03
297	601333	广深铁路	48,400	133,100.00	0.03
298	300201	海伦哲	6,300	132,741.00	0.03
299	000060	中金岭南	17,500	132,475.00	0.03
300	300002	神州泰岳	16,900	131,989.00	0.03
301	601901	方正证券	18,300	131,760.00	0.03
302	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.02
303	002080	中材科技	1,400	126,000.00	0.02
304	000750	国海证券	34,200	125,856.00	0.02
305	603505	金石资源	6,200	124,930.00	0.02
306	002756	永兴材料	2,200	124,608.00	0.02
307	688475	萤石网络	4,553	124,524.55	0.02
308	002824	和胜股份	3,600	124,488.00	0.02

309	600641	先导基电	3,100	123,566.00	0.02
310	688563	航材股份	2,400	122,952.00	0.02
311	002532	天山铝业	11,400	122,322.00	0.02
312	002025	航天电器	1,600	121,952.00	0.02
313	002984	森麒麟	9,300	121,551.00	0.02
314	600699	均胜电子	5,600	121,016.00	0.02
315	002262	恩华药业	6,400	120,000.00	0.02
316	600298	安琪酵母	3,300	119,460.00	0.02
317	601899	紫金矿业	4,700	118,158.00	0.02
318	300487	蓝晓科技	2,000	117,700.00	0.02
319	300055	万邦达	18,300	117,669.00	0.02
320	300763	锦浪科技	1,300	117,455.00	0.02
321	000935	四川双马	4,500	117,405.00	0.02
322	000623	吉林敖东	6,600	117,018.00	0.02
323	300024	机器人	6,000	115,980.00	0.02
324	300550	和仁科技	8,700	115,971.00	0.02
325	002487	大金重工	2,000	115,940.00	0.02
326	002945	华林证券	8,600	115,498.00	0.02
327	300073	当升科技	2,400	115,296.00	0.02
328	300012	华测检测	8,300	115,038.00	0.02
329	300474	景嘉微	1,900	114,912.00	0.02
330	603379	三美股份	1,500	113,835.00	0.02
331	600153	建发股份	14,300	113,399.00	0.02
332	000733	振华科技	2,000	113,280.00	0.02
333	000661	长春高新	1,700	113,220.00	0.02
334	003816	中国广核	28,900	112,999.00	0.02
335	000977	浪潮信息	1,600	112,000.00	0.02
336	600188	兖矿能源	6,300	111,951.00	0.02
337	300246	宝莱特	7,900	111,153.00	0.02
338	603920	世运电路	2,300	110,492.00	0.02
339	300803	指南针	1,200	110,004.00	0.02
340	600256	广汇能源	22,200	109,668.00	0.02
341	002157	正邦科技	38,800	109,028.00	0.02
342	300003	乐普医疗	9,200	109,020.00	0.02
343	603105	芯能科技	16,000	108,960.00	0.02
344	603093	南华期货	6,000	108,900.00	0.02
345	000423	东阿阿胶	2,400	108,864.00	0.02
346	002078	太阳纸业	8,700	108,663.00	0.02
347	300748	金力永磁	3,500	107,975.00	0.02
348	603336	宏辉果蔬	13,600	107,712.00	0.02
349	300263	隆华科技	6,600	107,580.00	0.02
350	603444	吉比特	300	107,526.00	0.02
351	002252	上海莱士	24,700	107,198.00	0.02

352	688188	柏楚电子	1,000	106,700.00	0.02
353	002156	通富微电	1,400	106,218.00	0.02
354	300724	捷佳伟创	1,500	105,900.00	0.02
355	688067	爱威科技	5,239	105,565.85	0.02
356	688192	迪哲医药	2,634	105,175.62	0.02
357	600295	鄂尔多斯	9,800	105,056.00	0.02
358	600299	安迪苏	13,200	103,620.00	0.02
359	300623	捷捷微电	2,300	103,477.00	0.02
360	000709	河钢股份	53,000	102,820.00	0.02
361	603885	吉祥航空	9,900	101,871.00	0.02
362	600707	彩虹股份	6,000	101,340.00	0.02
363	601696	中银证券	8,000	101,200.00	0.02
364	000728	国元证券	13,500	101,115.00	0.02
365	002056	横店东磁	3,300	100,584.00	0.02
366	002443	金洲管道	10,500	100,065.00	0.02
367	300142	沃森生物	7,700	100,023.00	0.02
368	688522	纳睿雷达	4,974	99,579.48	0.02
369	603119	浙江荣泰	1,500	99,510.00	0.02
370	600348	华阳股份	12,900	98,685.00	0.02
371	002835	同为股份	8,600	98,642.00	0.02
372	600369	西南证券	23,900	96,078.00	0.02
373	000629	钒钛股份	28,700	95,858.00	0.02
374	002111	威海广泰	10,600	95,400.00	0.02
375	603311	金海高科	2,600	95,290.00	0.02
376	600132	重庆啤酒	2,300	94,990.00	0.02
377	601000	唐山港	22,500	93,375.00	0.02
378	688266	泽璟制药	800	93,328.00	0.02
379	688679	通源环境	2,200	92,598.00	0.02
380	600959	江苏有线	31,700	91,613.00	0.02
381	601118	海南橡胶	18,600	91,512.00	0.02
382	000786	北新建材	5,000	90,450.00	0.02
383	301033	迈普医学	1,700	88,043.00	0.02
384	001203	大中矿业	2,900	86,855.00	0.02
385	300972	万辰集团	500	86,705.00	0.02
386	002064	华峰化学	9,100	86,359.00	0.02
387	688065	凯赛生物	1,800	86,130.00	0.02
388	002244	滨江集团	11,100	84,360.00	0.02
389	300679	电连技术	1,400	83,986.00	0.02
390	300596	利安隆	1,600	83,968.00	0.02
391	002673	西部证券	12,900	83,721.00	0.02
392	688375	国博电子	800	83,440.00	0.02
393	688568	中科星图	2,000	82,940.00	0.02
394	603927	中科软	6,500	82,615.00	0.02

395	002223	鱼跃医疗	3,200	82,112.00	0.02
396	000559	万向钱潮	6,300	81,459.00	0.02
397	600863	华能蒙电	17,300	81,310.00	0.02
398	000983	山西焦煤	14,000	81,200.00	0.02
399	000539	粤电力 A	11,900	81,039.00	0.02
400	600060	海信视像	2,900	80,823.00	0.02
401	603707	健友股份	11,300	79,891.00	0.02
402	002837	英维克	1,000	79,560.00	0.02
403	002318	久立特材	3,300	78,870.00	0.01
404	301298	东利机械	6,700	77,519.00	0.01
405	002643	万润股份	3,700	77,515.00	0.01
406	601156	东航物流	4,800	77,376.00	0.01
407	603568	伟明环保	5,000	76,900.00	0.01
408	688018	乐鑫科技	600	76,752.00	0.01
409	002085	万丰奥威	6,900	76,521.00	0.01
410	605299	舒华体育	5,700	76,095.00	0.01
411	002174	游族网络	6,000	75,660.00	0.01
412	600595	中孚实业	13,400	75,308.00	0.01
413	001979	招商蛇口	11,500	73,945.00	0.01
414	600316	洪都航空	2,600	72,644.00	0.01
415	601717	中创智领	5,200	72,332.00	0.01
416	002956	西麦食品	3,460	71,829.60	0.01
417	600535	天士力	5,400	71,442.00	0.01
418	603196	璞源材料	2,900	70,876.00	0.01
419	603606	东方电缆	1,700	70,567.00	0.01
420	600862	中航高科	3,900	70,317.00	0.01
421	000776	广发证券	3,000	70,200.00	0.01
422	002739	儒意电影	7,300	70,080.00	0.01
423	688182	灿勤科技	1,600	68,912.00	0.01
424	600177	雅戈尔	9,100	68,523.00	0.01
425	301093	华兰股份	500	67,815.00	0.01
426	000400	许继电气	3,100	67,270.00	0.01
427	688060	云涌科技	2,041	67,128.49	0.01
428	688608	恒玄科技	400	66,876.00	0.01
429	603558	健盛集团	6,000	66,540.00	0.01
430	600578	京能电力	10,300	66,435.00	0.01
431	601016	节能风电	17,000	65,960.00	0.01
432	002439	启明星辰	5,200	65,780.00	0.01
433	000519	中兵红箭	3,100	65,317.00	0.01
434	001332	锡装股份	1,660	65,188.20	0.01
435	600499	科达制造	4,700	64,860.00	0.01
436	301189	奥尼电子	1,100	64,823.00	0.01
437	600521	华海药业	4,500	64,800.00	0.01

438	603121	华培动力	5,500	64,625.00	0.01
439	603596	伯特利	2,600	64,584.00	0.01
440	002044	美年健康	12,800	64,384.00	0.01
441	600737	中粮糖业	5,200	64,116.00	0.01
442	600171	上海贝岭	2,000	63,880.00	0.01
443	301469	恒达新材	2,300	63,434.00	0.01
444	000039	中集集团	7,800	63,258.00	0.01
445	002153	石基信息	8,700	62,901.00	0.01
446	601567	三星电气	4,200	62,748.00	0.01
447	000528	柳工	8,300	62,665.00	0.01
448	002236	大华股份	3,800	62,662.00	0.01
449	002216	三全食品	5,400	62,262.00	0.01
450	603290	斯达半导	400	61,176.00	0.01
451	002965	祥鑫科技	1,200	61,140.00	0.01
452	300059	东方财富	3,000	61,140.00	0.01
453	002033	丽江股份	7,400	61,124.00	0.01
454	601066	中信建投	2,100	61,047.00	0.01
455	002152	广电运通	6,500	60,970.00	0.01
456	000792	盐湖股份	2,000	60,380.00	0.01
457	001696	宗申动力	2,900	60,349.00	0.01
458	601601	中国太保	2,100	59,892.00	0.01
459	300867	圣元环保	3,300	59,796.00	0.01
460	600873	梅花生物	8,100	59,535.00	0.01
461	688084	晶品特装	1,176	59,129.28	0.01
462	600100	同方股份	8,500	58,225.00	0.01
463	000922	佳电股份	4,160	58,073.60	0.01
464	601098	中南传媒	5,900	58,056.00	0.01
465	603225	新凤鸣	2,900	56,985.00	0.01
466	002285	世联行	27,700	56,785.00	0.01
467	000729	燕京啤酒	5,500	55,715.00	0.01
468	001337	四川黄金	1,500	54,990.00	0.01
469	688132	邦彦技术	4,144	54,493.60	0.01
470	002049	紫光国微	600	53,250.00	0.01
471	002054	德美化工	8,000	53,200.00	0.01
472	603387	基蛋生物	7,000	52,920.00	0.01
473	603223	恒通股份	4,000	52,200.00	0.01
474	601216	君正集团	11,700	52,182.00	0.01
475	600018	上港集团	11,000	51,920.00	0.01
476	600516	方大炭素	8,400	51,828.00	0.01
477	600030	中信证券	1,800	51,714.00	0.01
478	002939	长城证券	6,200	51,708.00	0.01
479	603638	艾迪精密	2,200	51,590.00	0.01
480	601163	三角轮胎	4,000	50,760.00	0.01

481	001218	丽臣实业	2,300	50,738.00	0.01
482	600999	招商证券	2,400	50,640.00	0.01
483	000301	东方盛虹	4,400	50,380.00	0.01
484	600323	瀚蓝环境	1,800	49,428.00	0.01
485	603006	联明股份	3,400	48,450.00	0.01
486	000830	鲁西化工	4,000	48,000.00	0.01
487	688101	三达膜	2,750	45,457.50	0.01
488	603966	法兰泰克	5,530	45,069.50	0.01
489	300929	华骐环保	4,200	44,268.00	0.01
490	600549	厦门钨业	500	42,600.00	0.01
491	600489	中金黄金	2,300	41,515.00	0.01
492	688025	杰普特	84	39,480.00	0.01
493	601872	招商轮船	1,800	31,626.00	0.01
494	601611	中国核建	2,800	31,220.00	0.01
495	002624	完美世界	1,400	17,388.00	0.00
496	603163	圣晖集成	100	14,650.00	0.00
497	688685	迈信林	200	10,980.00	0.00
498	688981	中芯国际	45	7,146.90	0.00
499	688551	科威尔	90	6,324.30	0.00
500	002240	盛新锂能	100	4,483.00	0.00
501	605020	永和股份	100	4,072.00	0.00
502	301349	信德新材	40	2,944.00	0.00
503	301110	青木科技	60	2,271.60	0.00
504	301219	腾远钴业	30	1,644.00	0.00
505	603969	银龙股份	100	727.00	0.00
506	688633	星球石墨	22	654.06	0.00
507	601933	永辉超市	100	284.00	0.00
508	688689	银河微电	2	129.44	0.00
509	300453	三鑫医疗	10	90.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300547	川环科技	6,582,250.00	1.25
2	002436	兴森科技	6,373,875.00	1.21
3	688981	中芯国际	6,148,358.09	1.17
4	688778	厦钨新能	5,964,534.62	1.13
5	300593	新雷能	5,931,022.00	1.13
6	600233	圆通速递	5,542,471.00	1.05
7	605117	德业股份	5,262,293.20	1.00
8	603659	璞泰来	5,105,439.00	0.97
9	002317	众生药业	4,841,449.00	0.92

10	002120	韵达股份	4,558,415.00	0.86
11	688112	鼎阳科技	4,553,192.94	0.86
12	301511	德福科技	4,547,768.80	0.86
13	002821	凯莱英	4,526,622.00	0.86
14	002415	海康威视	4,477,120.00	0.85
15	600111	北方稀土	4,467,061.00	0.85
16	600546	山煤国际	4,404,626.00	0.84
17	002768	国恩股份	4,337,706.00	0.82
18	300677	英科医疗	4,177,024.00	0.79
19	688551	科威尔	4,148,716.96	0.79
20	002392	北京利尔	4,037,036.00	0.77

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002436	兴森科技	7,310,724.00	1.39
2	688981	中芯国际	6,818,719.21	1.29
3	300547	川环科技	6,070,748.00	1.15
4	300593	新雷能	5,414,526.00	1.03
5	688551	科威尔	5,369,935.37	1.02
6	301511	德福科技	5,291,928.00	1.00
7	688778	厦钨新能	5,191,908.25	0.99
8	002768	国恩股份	5,060,795.00	0.96
9	002821	凯莱英	5,005,572.00	0.95
10	002317	众生药业	4,773,841.84	0.91
11	605117	德业股份	4,714,036.00	0.89
12	688112	鼎阳科技	4,615,444.04	0.88
13	603659	璞泰来	4,587,903.00	0.87
14	600233	圆通速递	4,544,214.00	0.86
15	600111	北方稀土	4,470,081.00	0.85
16	002415	海康威视	4,399,885.00	0.83
17	001339	智微智能	4,237,809.40	0.80
18	605020	永和股份	4,093,910.00	0.78
19	603163	圣晖集成	4,058,500.00	0.77
20	002120	韵达股份	3,921,509.45	0.74

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	344,158,613.51
卖出股票收入（成交）总额	251,144,300.52

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	20,032,915.07	3.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	71,688,440.00	13.60
	其中：政策性金融债	20,126,115.07	3.82
4	企业债券	20,764,098.63	3.94
5	企业短期融资券	20,030,389.04	3.80
6	中期票据	236,601,668.48	44.90
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	369,117,511.22	70.04

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	2128047	21 招商银行永续债	300,000	30,904,818.08	5.86
2	1680298	16 穗城投债01	200,000	20,764,098.63	3.94
3	102101444	21 知识城MTN005	200,000	20,748,672.88	3.94
4	102101292	21 渝高速MTN001	200,000	20,690,054.79	3.93
5	102101872	21 无锡建投MTN004	200,000	20,689,949.59	3.93

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本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 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 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

招商银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到监管部门处罚，本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同约定备选股票库之外的股票。

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	29,756.06
2	应收清算款	7,096,991.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,605,632.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,732,380.67

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	2,163,200.00	0.41	重大事项

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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 (%)
泰信添瑞 债券 A	203	295,001.02	10,997,043.97	18.36	48,888,162.23	81.64
泰信添瑞 债券 C	1,158	398,806.39	41,275,795.42	8.94	420,542,006.80	91.06
合计	1,361	383,323.30	52,272,839.39	10.02	469,430,169.03	89.98

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	泰信添瑞债券 A	95,679.54	0.1598
	泰信添瑞债券 C	—	—
	合计	95,679.54	0.0183

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究部门负责人持有本开 放式基金	泰信添瑞债券 A	0
	泰信添瑞债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	泰信添瑞债券 A	0~10
	泰信添瑞债券 C	0
	合计	0~10

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	泰信添瑞债券 A	泰信添瑞债券 C
基金合同生效日 (2026 年 4 月 30 日) 基金份额总额	107, 222, 518. 98	945, 920, 536. 55
基金合同生效日起 至报告期期末基金 总申购份额	1, 298, 650. 17	11, 650, 348. 54
减：基金合同生效 日起至报告期期末 基金总赎回份额	48, 635, 962. 95	495, 753, 082. 87
基金合同生效日起 至报告期期末基金 拆分变动份额	—	—
本报告期末基金 份额总额	59, 885, 206. 20	461, 817, 802. 22

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、自 2026 年 2 月 10 日起，张芸红不再担任首席财务官。具体详情参见 2026 年 2 月 10 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》。

2、自 2026 年 3 月 10 日起，段晓旭担任首席财务官。具体详情参见 2026 年 3 月 10 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》。

3、自 2026 年 6 月 22 日起，刘玉成担任首席信息官，总经理张秉麟不再代任首席信息官职务。具体详情参见 2026 年 6 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高级管理人员变更公告》。

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无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
浙商证券	2	595,302,914.03	100.00	265,444.74	100.00	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

注：1、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、财务状况、处罚情况、内部控制等。公司通过规范选择券商租用专用交易席位的流程，对券商提供的研究服务情况进行定期考评，考评结果将成为交易席位租用与分配交易量的主要依据。

2、本报告期内本基金新增交易单元：无；退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用或者通过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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
浙商证券	-	-	2,243,000,000.00	100.00	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰信添瑞债券型证券投资基金发售募集文件	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 20 日
2	泰信基金管理有限公司关于泰信添瑞债券型证券投资基金新增销售机构的公告	规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 10 日
3	泰信基金管理有限公司关于泰信添瑞债券型证券投资基金提前结束募集的公告	规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 20 日
4	泰信基金管理有限公司关于泰信添瑞债券型证券投资基金新增销售机构的公告	规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 24 日
5	泰信添瑞债券型证券投资基金基金合同生效公告	规定报刊及规定网站	2026 年 5 月 6 日
6	泰信添瑞债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	规定报刊及规定网站	2026 年 5 月 26 日
7	泰信基金管理有限公司关于泰信添瑞债券型证券投资基金在部分销售机构开通定投、转换及参加费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2026 年 5 月 27 日
8	泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊及规定网站	2026 年 6 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信添瑞债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信添瑞债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信添瑞债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信添瑞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、基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

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

2026 年 8 月 28 日