

泰信中证全指自由现金流指数型证券投资
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 1 月 1 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	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	46

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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
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	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金	
基金简称	泰信中证全指自由现金流指数	
基金主代码	025003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 2 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	54,007,789.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	泰信中证全指自由现金流指数 A	泰信中证全指自由现金流指数 C
下属分级基金的交 易代码	025003	025004
报告期末下属分级 基金的份额总额	30,775,070.70 份	23,232,718.96 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证全指自由现金流指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 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	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	泰信中证全指自由现金流指数 A	泰信中证全指自由现金流指数 C
本期已实现收益	2,968,629.34	4,245,401.95
本期利润	-1,351,886.25	1,015,473.77
加权平均基金份额 本期利润	-0.0315	0.0248
本期加权平均净 值利润率	-2.99%	2.35%
本期基金份额净 值增长率	-11.13%	-11.22%
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	-2,980,902.38	-2,275,738.40
期末可供分配基 金份额利润	-0.0969	-0.0980
期末基金资产净 值	27,794,168.32	20,956,980.56

期末基金份额净值	0.9031	0.9020
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	-9.69%	-9.80%

- 注：1、本基金基金合同于 2025 年 12 月 02 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

泰信中证全指自由现金流指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-15.18%	0.82%	-16.32%	0.84%	1.14%	-0.02%
过去六个月	-11.13%	1.03%	-11.82%	1.04%	0.69%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-9.69%	0.95%	-10.35%	0.99%	0.66%	-0.04%

泰信中证全指自由现金流指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-15.22%	0.82%	-16.32%	0.84%	1.10%	-0.02%
过去六个月	-11.22%	1.03%	-11.82%	1.04%	0.60%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-9.80%	0.95%	-10.35%	0.99%	0.55%	-0.04%

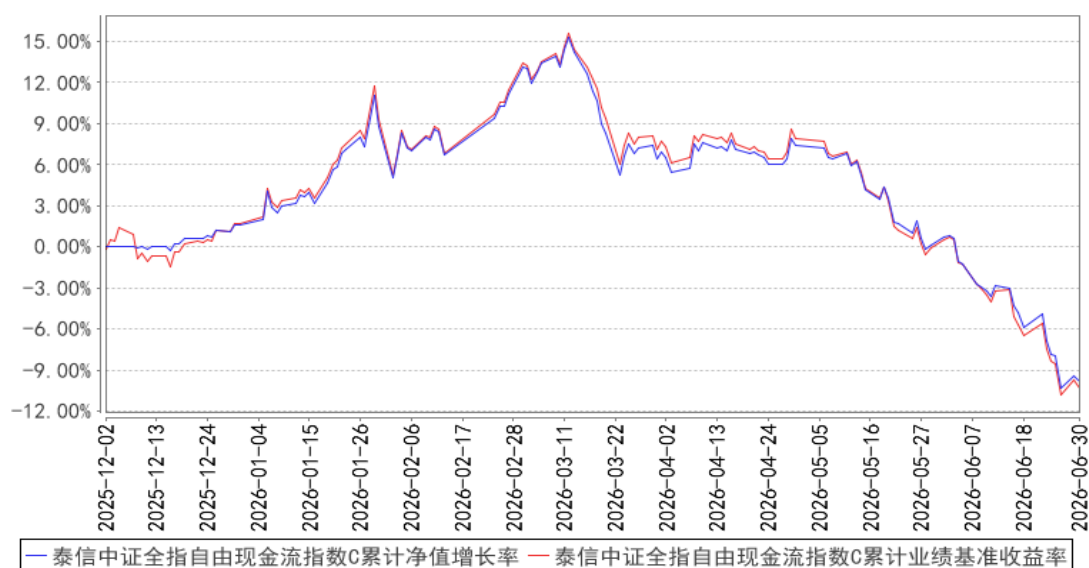
注：本基金的业绩比较基准为：中证全指自由现金流指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%

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

泰信中证全指自由现金流指数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



泰信中证全指自由现金流指数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 2025 年 12 月 2 日生效。

2、本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票及存托凭证的资产不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）的资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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 指数证券投资基金基金经理、泰	2025 年 12 月 2 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

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				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
--	--	--	--	--

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》、《泰信中证全指自由现金流指数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，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。

作为被动操作的指数基金，报告期内本基金严格执行基金合同规定的投资策略，通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，以实现对标的有效跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信中证全指自由现金流指数 A 基金份额净值为 0.9031 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.13%；截止本报告期末泰信中证全指自由现金流指数 C 基金份额净值为 0.9020 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.22%；同期业绩比较基准收益率为-11.82%。

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，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。

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、基金管理人可对基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供收益分配利润进行评价，在符合收益分配相关规定的前提下，基金管理人可进行收益分配；

2、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；

3、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；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，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；

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，基金托管人在本基金的托管过程中，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本基金投资运作、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本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：泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	6.4.7.1	574,075.80	6,043,746.72
结算备付金		2,653,035.59	62,601,549.45
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	46,116,371.60	191,644,099.20
其中：股票投资		46,116,371.60	191,644,099.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-12,951.13
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		17,731.72	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		49,361,214.71	260,276,444.24
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		488,529.34	-
应付管理人报酬		23,220.51	102,086.50
应付托管费		4,644.11	20,417.32
应付销售服务费		3,762.28	26,082.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1,928.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	89,909.59	-
负债合计		610,065.83	150,514.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	54,007,789.66	256,010,654.95
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-5,256,640.78	4,115,274.67
净资产合计		48,751,148.88	260,125,929.62
负债和净资产总计		49,361,214.71	260,276,444.24

注： 1、本基金合同生效日为 2025 年 12 月 2 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 12 月 2 日至 2025 年 12 月 31 日。

2、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 54,007,789.66 份。其中：泰信中证全指自由现金流指数 A 份额净值人民币 0.9031 元，基金份额总额 30,775,070.70 份；泰信中证全指自由现金流指数 C 份额净值人民币 0.9020 元，基金份额总额 23,232,718.96 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		56,281.96
1. 利息收入		21,649.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	9,075.93
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		12,573.93
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,578,865.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	6,766,261.63
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
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	812,603.78
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	-7,550,443.77

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	6, 210. 46
减：二、营业总支出		392, 694. 44
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	225, 156. 67
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	45, 031. 35
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	44, 732. 66
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 18	-
7. 税金及附加		45. 26
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	77, 728. 50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-336, 412. 48
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-336, 412. 48
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-336, 412. 48

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 2 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：泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 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	256, 010, 654. 95	-	4, 115, 274. 67	260, 125, 929. 62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	256, 010, 654. 95	-	4, 115, 274. 67	260, 125, 929. 62
三、本期增减变	-	-	-9, 371, 915. 45	-211, 374, 780. 74

动额(减少以“-”号填列)	202,002,865.29			
(一)、综合收益总额	-	-	-336,412.48	-336,412.48
(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)	- 202,002,865.29	-	-9,035,502.97	-211,038,368.26
其中：1. 基金申购款	50,399,151.82	-	3,472,798.96	53,871,950.78
2. 基金赎回款	- 252,402,017.11	-	-12,508,301.93	-264,910,319.04
(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	54,007,789.66	-	-5,256,640.78	48,751,148.88

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 2 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

泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金(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 1372 号《关于准予泰信中证全指自由现金流指数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《泰信中证全指自由现金流指数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/申购费用、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 256,010,654.95 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(25)第 00405 号验资报告。《泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2025 年 12 月 2 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《泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于其他国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款以及其他银行存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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：本基金投资于股票及存托凭证的资产不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）的资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。本基金的业绩比较基准为：中证全指自由现金流指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 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 1 月 1 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 1 月 1 日起至 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。

6.4.4.4 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) 基金管理人可对基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供收益分配利润进行评价，在符合收益分配相关规定的前提下，基金管理人可进行收益分配；

2) 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；

3) 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；

4) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，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；

5) 法律法规或监管机构另有规定的，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	574,075.80
等于：本金	573,863.59
加：应计利息	212.21
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	574,075.80

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		49,537,160.68	-	46,116,371.60	-3,420,789.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		49,537,160.68	-	46,116,371.60	-3,420,789.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	77,689.59

其他	12,220.00
合计	89,909.59

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

泰信中证全指自由现金流指数 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	92,481,851.41	92,481,851.41
本期申购	25,528,451.85	25,528,451.85
本期赎回（以“-”号填列）	-87,235,232.56	-87,235,232.56
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	30,775,070.70	30,775,070.70

泰信中证全指自由现金流指数 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	163,528,803.54	163,528,803.54
本期申购	24,870,699.97	24,870,699.97
本期赎回（以“-”号填列）	-165,166,784.55	-165,166,784.55
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	23,232,718.96	23,232,718.96

注：申购含红利再投、转换入及份额级别调增数，赎回含转换出及份额级别调减数。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

泰信中证全指自由现金流指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,227.63	1,491,916.17	1,496,143.80
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,227.63	1,491,916.17	1,496,143.80
本期利润	2,968,629.34	-4,320,515.59	-1,351,886.25
本期基金份额交易产生的变动数	-1,891,080.33	-1,234,079.60	-3,125,159.93
其中：基金申购款	1,867,458.60	-391,343.79	1,476,114.81

基金赎回款	-3,758,538.93	-842,735.81	-4,601,274.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,081,776.64	-4,062,679.02	-2,980,902.38

泰信中证全指自由现金流指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-18,607.65	2,637,738.52	2,619,130.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-18,607.65	2,637,738.52	2,619,130.87
本期利润	4,245,401.95	-3,229,928.18	1,015,473.77
本期基金份额交易产生的变动数	-3,438,282.72	-2,472,060.32	-5,910,343.04
其中：基金申购款	1,578,089.97	418,594.18	1,996,684.15
基金赎回款	-5,016,372.69	-2,890,654.50	-7,907,027.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	788,511.58	-3,064,249.98	-2,275,738.40

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,058.98
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	828.67
其他	1,188.28
合计	9,075.93

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1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,766,261.63
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	6,766,261.63

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	262,459,029.69
减：卖出股票成本总额	255,462,536.04
减：交易费用	230,232.02
买卖股票差价收入	6,766,261.63

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	812,603.78
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	812,603.78

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,550,443.77
股票投资	-7,550,443.77
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-7,550,443.77

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,210.46
合计	6,210.46

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

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

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	18,182.22
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	38.91
合计	77,728.50

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	225,156.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	109,372.37
应支付基金管理人的净管理费	115,784.30

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,031.35

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%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=前一日基金资产净值×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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信中证全指自由现金流指数 A	泰信中证全指自由现金流指数 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	583.46	583.46
交通银行	-	15,061.11	15,061.11
合计	-	15,644.57	15,644.57

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

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	泰信中证全指自由现金流指数 A	泰信中证全指自由现金流指数 C
基金合同生效日（ 2025 年 12 月 2 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	4,877,985.01	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	4,877,985.01	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.03%	-

注：基金管理人运用固有资金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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	574,075.80	7,058.98

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	122	1,363.96	2,145.98	-
603284	林平	2026 年 2	6 个月	新股流通	37.88	34.87	24	909.12	836.88	-

	发 展	月 3 日		受限						
--	--------	----------	--	----	--	--	--	--	--	--

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6. 4. 12. 2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6. 4. 12. 3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易作为抵押的债券。

6. 4. 12. 4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6. 4. 13 金融工具风险及管理

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

6. 4. 13. 1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，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。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合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 0.0061%。

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 46,216,316.65 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	574,075.80	-	-	-	574,075.80
结算备付金	2,653,035.59	-	-	-	2,653,035.59
交易性金融资产	-	-	-	46,116,371.60	46,116,371.60
应收申购款	-	-	-	17,731.72	17,731.72
资产总计	3,227,111.39	-	-	46,134,103.32	49,361,214.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	488,529.34	488,529.34
应付管理人报酬	-	-	-	23,220.51	23,220.51
应付托管费	-	-	-	4,644.11	4,644.11
应付销售服务费	-	-	-	3,762.28	3,762.28

其他负债	-	-	-	89,909.59	89,909.59
负债总计	-	-	-	610,065.83	610,065.83
利率敏感度缺口	3,227,111.39	-	-	45,524,037.49	48,751,148.88
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,043,746.72	-	-	-	6,043,746.72
结算备付金	62,601,549.45	-	-	-	62,601,549.45
交易性金融资产	-	-	-	191,644,099.20	191,644,099.20
买入返售金融资产	-12,951.13	-	-	-	-12,951.13
资产总计	68,632,345.04	-	-	191,644,099.20	260,276,444.24
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	102,086.50	102,086.50
应付托管费	-	-	-	20,417.32	20,417.32
应付销售服务费	-	-	-	26,082.71	26,082.71
应交税费	-	-	-	1,928.09	1,928.09
负债总计	-	-	-	150,514.62	150,514.62
利率敏感度缺口	68,632,345.04	-	-	191,493,584.58	260,125,929.62

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 其他价格风险

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

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	46,116,371.60	94.60	191,644,099.20	73.67
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	46,116,371.60	94.60	191,644,099.20	73.67

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）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,186,998.76	8,917,232.25
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,186,998.76	-8,917,232.25

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	46,113,388.74	191,644,099.20
第二层次	－	－
第三层次	2,982.86	－

合计	46, 116, 371. 60	191, 644, 099. 20
----	------------------	-------------------

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	46, 116, 371. 60	93. 43
	其中：股票	46, 116, 371. 60	93. 43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3, 227, 111. 39	6. 54
8	其他各项资产	17, 731. 72	0. 04
9	合计	49, 361, 214. 71	100. 00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	1,920,975.00	3.94
C	制造业	31,804,838.41	65.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	463,157.00	0.95
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	2,311,430.00	4.74
G	交通运输、仓储和邮政业	3,761,934.76	7.72
H	住宿和餐饮业	377,832.00	0.78
I	信息传输、软件和信息技术服务业	859,821.00	1.76
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	1,981,262.00	4.06
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	24,362.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	211,455.00	0.43
S	综合	—	—
	合计	43,717,067.17	89.67

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	134,402.00	0.28
C	制造业	1,595,119.43	3.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,324.00	0.13

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	92,837.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	89,656.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	177,642.00	0.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	98,664.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	53,260.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	92,400.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	2,399,304.43	4.92

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	123,500	4,631,250.00	9.50
2	601633	长城汽车	284,569	4,294,146.21	8.81
3	000100	TCL 科技	665,100	3,870,882.00	7.94
4	601600	中国铝业	336,600	2,766,852.00	5.68
5	601877	正泰电器	107,900	2,705,053.00	5.55
6	000708	中信特钢	118,500	1,495,470.00	3.07
7	688599	天合光能	87,000	1,228,440.00	2.52
8	601699	潞安环能	81,800	1,168,104.00	2.40
9	600482	中国动力	32,900	1,079,120.00	2.21
10	000933	神火股份	50,200	1,064,240.00	2.18

11	002027	分众传媒	217,300	1,051,732.00	2.16
12	603885	吉祥航空	95,400	981,666.00	2.01
13	002532	天山铝业	90,300	968,919.00	1.99
14	600057	厦门象屿	171,500	929,530.00	1.91
15	601156	东航物流	51,000	822,120.00	1.69
16	600096	云天化	19,100	580,640.00	1.19
17	603883	老百姓	50,800	556,768.00	1.14
18	603565	中谷物流	55,000	539,550.00	1.11
19	600623	华谊集团	65,200	526,164.00	1.08
20	603233	大参林	32,200	483,966.00	0.99
21	600295	鄂尔多斯	44,900	481,328.00	0.99
22	603766	隆鑫通用	38,700	461,691.00	0.95
23	600535	天士力	33,600	444,528.00	0.91
24	600961	株冶集团	13,400	434,026.00	0.89
25	601880	辽港股份	314,052	433,391.76	0.89
26	002558	巨人网络	15,400	424,424.00	0.87
27	600428	中远海特	49,700	388,157.00	0.80
28	002727	一心堂	40,300	386,477.00	0.79
29	600258	首旅酒店	34,600	377,832.00	0.78
30	600167	联美控股	67,300	376,207.00	0.77
31	600216	浙江医药	32,200	367,080.00	0.75
32	600211	西藏药业	9,700	362,683.00	0.74
33	600858	银座股份	79,900	352,359.00	0.72
34	002563	森马服饰	69,300	349,272.00	0.72
35	601083	锦江航运	32,300	321,062.00	0.66
36	002668	TCL 智家	27,700	306,916.00	0.63
37	002390	信邦制药	115,000	300,150.00	0.62
38	001338	永顺泰	35,600	298,684.00	0.61
39	002918	蒙娜丽莎	28,100	282,405.00	0.58
40	600351	亚宝药业	48,300	277,725.00	0.57
41	601001	晋控煤业	15,600	271,284.00	0.56
42	600256	广汇能源	53,900	266,266.00	0.55
43	688819	天能股份	11,801	261,982.20	0.54
44	000423	东阿阿胶	5,700	258,552.00	0.53
45	603192	汇得科技	15,200	257,488.00	0.53
46	000848	承德露露	34,000	251,600.00	0.52
47	600131	国网信通	16,900	246,740.00	0.51
48	001220	世盟股份	8,600	243,466.00	0.50
49	601216	君正集团	54,100	241,286.00	0.49
50	600218	全柴动力	30,700	221,654.00	0.45
51	002043	兔宝宝	19,700	218,276.00	0.45
52	600546	山煤国际	19,700	215,321.00	0.44
53	000719	中原传媒	18,500	211,455.00	0.43

54	600398	海澜之家	40,200	210,246.00	0.43
55	603444	吉比特	500	179,210.00	0.37
56	603367	辰欣药业	13,400	171,922.00	0.35
57	600380	健康元	16,900	159,198.00	0.33
58	300407	凯发电气	12,300	132,840.00	0.27
59	600738	丽尚国潮	28,500	102,600.00	0.21
60	603939	益丰药房	5,700	102,486.00	0.21
61	603080	新疆火炬	4,700	86,950.00	0.18
62	000513	丽珠集团	3,000	86,670.00	0.18
63	600033	福建高速	10,100	32,522.00	0.07
64	002697	红旗连锁	6,400	26,624.00	0.05
65	300244	迪安诊断	1,300	24,362.00	0.05
66	600449	宁夏建材	2,000	22,360.00	0.05
67	000650	仁和药业	2,800	14,252.00	0.03
68	300770	新媒股份	300	9,447.00	0.02
69	000404	长虹华意	1,100	8,646.00	0.02
70	300228	富瑞特装	1,100	8,140.00	0.02
71	603456	九洲药业	100	1,366.00	0.00
72	600300	维维股份	300	846.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.11
2	301093	华兰股份	400	54,252.00	0.11
3	300948	冠中生态	2,000	53,260.00	0.11
4	600113	浙江东日	1,600	53,088.00	0.11
5	600183	生益科技	300	52,020.00	0.11
6	688301	奕瑞科技	400	49,600.00	0.10
7	603773	沃格光电	300	48,891.00	0.10
8	002328	新朋股份	6,500	47,710.00	0.10
9	603311	金海高科	1,300	47,645.00	0.10
10	002682	龙洲股份	11,200	47,488.00	0.10
11	300596	利安隆	900	47,232.00	0.10
12	600714	金瑞矿业	2,300	47,219.00	0.10
13	603990	麦迪科技	2,200	46,838.00	0.10
14	002174	游族网络	3,700	46,657.00	0.10
15	000892	欢瑞世纪	14,000	46,620.00	0.10
16	603679	华体科技	2,300	46,414.00	0.10
17	600397	江钨装备	1,700	46,291.00	0.09
18	300587	天铁科技	12,000	46,200.00	0.09
19	600075	新疆天业	11,400	46,056.00	0.09
20	600808	马钢股份	18,400	46,000.00	0.09

21	002343	慈文传媒	10,500	45,780.00	0.09
22	002221	东华能源	8,700	45,762.00	0.09
23	605168	三人行	900	45,576.00	0.09
24	603538	美诺华	1,400	45,570.00	0.09
25	603567	珍宝岛	10,400	45,552.00	0.09
26	603112	华翔股份	2,700	45,171.00	0.09
27	603186	华正新材	200	45,060.00	0.09
28	300055	万邦达	7,000	45,010.00	0.09
29	601179	中国西电	3,000	44,760.00	0.09
30	002913	奥士康	700	44,758.00	0.09
31	301568	思泰克	400	44,640.00	0.09
32	300959	线上线下	300	44,343.00	0.09
33	002259	升达林业	11,600	43,964.00	0.09
34	600938	中国海油	1,600	43,440.00	0.09
35	002734	利民股份	2,500	42,925.00	0.09
36	002805	丰元股份	1,500	42,885.00	0.09
37	600331	宏达股份	3,900	42,861.00	0.09
38	003023	彩虹集团	2,200	42,768.00	0.09
39	002951	金时科技	3,200	42,752.00	0.09
40	603150	万朗磁塑	600	42,480.00	0.09
41	603121	华培动力	3,600	42,300.00	0.09
42	601872	招商轮船	2,400	42,168.00	0.09
43	300255	常山药业	1,800	42,156.00	0.09
44	603931	格林达	700	41,580.00	0.09
45	603619	中曼石油	2,200	41,162.00	0.08
46	688677	海泰新光	400	40,452.00	0.08
47	301196	唯科科技	300	37,626.00	0.08
48	001203	大中矿业	1,200	35,940.00	0.07
49	688662	富信科技	200	33,600.00	0.07
50	600936	北投科技	6,500	27,950.00	0.06
51	688218	江苏北人	400	21,984.00	0.05
52	600726	华电能源	3,000	21,360.00	0.04
53	300843	胜蓝股份	100	15,625.00	0.03
54	000603	盛达资源	600	13,860.00	0.03
55	688253	英诺特	200	12,056.00	0.02
56	688258	卓易信息	100	11,854.00	0.02
57	600389	江山股份	600	11,712.00	0.02
58	000811	冰轮环境	200	11,244.00	0.02
59	301227	森鹰窗业	400	10,084.00	0.02
60	601112	振石股份	311	5,591.45	0.01
61	688127	蓝特光学	50	4,880.00	0.01
62	002378	章源钨业	80	2,678.40	0.01
63	002335	科华数据	60	2,547.00	0.01

64	600104	上汽集团	200	1,952.00	0.00
65	002831	裕同科技	40	1,422.40	0.00
66	300756	金马游乐	40	1,322.00	0.00
67	603284	林平发展	24	836.88	0.00
68	600785	新华百货	80	784.00	0.00
69	301039	中集车辆	100	705.00	0.00
70	002454	松芝股份	140	669.20	0.00
71	002396	星网锐捷	30	575.10	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601728	中国电信	7,141,788.00	2.75
2	600938	中国海油	6,047,612.00	2.32
3	601633	长城汽车	4,433,900.24	1.70
4	601600	中国铝业	3,498,121.00	1.34
5	601877	正泰电器	2,635,114.00	1.01
6	002352	顺丰控股	2,571,229.00	0.99
7	002415	海康威视	2,538,039.00	0.98
8	000100	TCL 科技	2,388,067.00	0.92
9	600104	上汽集团	2,234,621.00	0.86
10	000651	格力电器	2,160,526.00	0.83
11	002027	分众传媒	1,688,385.00	0.65
12	601699	潞安环能	1,460,044.00	0.56
13	000933	神火股份	1,430,333.00	0.55
14	688599	天合光能	1,426,773.49	0.55
15	000708	中信特钢	1,381,055.00	0.53
16	601212	白银有色	1,366,915.00	0.53
17	601156	东航物流	1,332,422.00	0.51
18	002532	天山铝业	1,239,122.00	0.48
19	600482	中国动力	1,237,432.00	0.48
20	600057	厦门象屿	1,227,783.00	0.47

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600938	中国海油	27,670,356.50	10.64
2	600104	上汽集团	17,055,526.00	6.56

3	000651	格力电器	13,611,927.00	5.23
4	601919	中远海控	9,187,743.99	3.53
5	601600	中国铝业	7,734,144.00	2.97
6	002714	牧原股份	7,526,066.00	2.89
7	601728	中国电信	7,146,001.00	2.75
8	000100	TCL 科技	6,492,627.90	2.50
9	600019	宝钢股份	6,232,333.05	2.40
10	601877	正泰电器	6,032,445.00	2.32
11	601633	长城汽车	5,401,124.00	2.08
12	601212	白银有色	5,162,858.00	1.98
13	000039	中集集团	4,846,850.00	1.86
14	600352	浙江龙盛	4,824,718.00	1.85
15	600482	中国动力	4,744,262.00	1.82
16	002648	卫星化学	4,595,504.00	1.77
17	000792	盐湖股份	4,126,862.00	1.59
18	000959	首钢股份	3,911,295.80	1.50
19	000708	中信特钢	3,888,426.00	1.49
20	000568	泸州老窖	3,866,562.13	1.49

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	117,485,252.21
卖出股票收入（成交）总额	262,459,029.69

注：

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金本报告期投资的前十名证券中发行主体未发生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、处罚的情况。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	138.06
5	应收申购款	17,593.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,731.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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 (%)
泰信中证 全指自由 现金流指 数 A	440	69,943.34	4,897,238.02	15.91	25,877,832.68	84.09
泰信中证 全指自由 现金流指 数 C	405	57,364.74	0.00	0.00	23,232,718.96	100.00
合计	845	63,914.54	4,897,238.02	9.07	49,110,551.64	90.93

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	泰信中证全指自由现金流指 数 A	—	—
	泰信中证全指自由现金流指 数 C	47,819.78	0.2058
	合计	47,819.78	0.0885

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	泰信中证全指自由现金流 指数 A	0
	泰信中证全指自由现金流 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	泰信中证全指自由现金流 指数 A	0

	泰信中证全指自由现金流 指数 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	泰信中证全指自由现金流指数 A	泰信中证全指自由现金流指数 C
基金合同生效日 （2025 年 12 月 2 日）基金份额总额	92,481,851.41	163,528,803.54
本报告期期初基金 份额总额	92,481,851.41	163,528,803.54
本报告期基金总申 购份额	25,528,451.85	24,870,699.97
减：本报告期基金 总赎回份额	87,235,232.56	165,166,784.55
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	30,775,070.70	23,232,718.96

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。

4、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

报告期内，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 (%)	
长城证券	3	379,921,954.76	100.00	74,481.05	100.00	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

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 (%)
长城证券	-	-	-	-	-	-

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	关于泰信中证全指自由现金流指数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 1 月 8 日
2	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 2 月 10 日
3	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 3 月 10 日
4	泰信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司“邮你同赢”同业平台为销售机构并开通转换业务的公告	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 17 日
5	泰信基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 30 日
6	泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金 2026 年第一季度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 21 日
7	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、中国证监会准予泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金注册的文件。
- 2、《泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金基金合同》。

3、《泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金托管协议》。

4、法律意见书。

5、基金管理人业务资格批件、营业执照。

6、基金托管人业务资格批件、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