

泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	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	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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	45
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	45
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	45

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	45
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.11 投资组合报告附注	45
§ 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
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
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	51
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金	
基金简称	泰信鑫瑞债券发起式	
基金主代码	013614	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 17 日	
基金管理人	泰信基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	30,108,439.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C
下属分级基金的交易代码	013614	013615
报告期末下属分级基金的份额总额	11,728,329.34 份	18,380,109.97 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	本基金根据宏观经济运行状况、政策形势、利率走势、信用状况等的综合判断，并结合各大类资产的估值水平和风险收益特征，在基金合同规定的范围内决定各类资产的配置比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘小舫	潘琦
	联系电话	021-20899003	0755-22168257
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95511-3
传真		021-20899008	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		200120	518001

法定代表人	李高峰	谢永林
-------	-----	-----

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)	
	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C
本期已实现收益	496,456.06	553,988.40
本期利润	-263,827.04	-78,406.63
加权平均基金份 额本期利润	-0.0205	-0.0026
本期加权平均净 值利润率	-2.13%	-0.27%
本期基金份额净 值增长率	-2.49%	-2.55%
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	-855,928.91	-1,435,960.32
期末可供分配基 金份额利润	-0.0730	-0.0781
期末基金资产净 值	10,872,400.43	16,944,149.65
期末基金份额净 值	0.9270	0.9219
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	-7.30%	-7.81%
-------------	--------	--------

注：1、本基金基金合同生效日为 2022 年 3 月 17 日。

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

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

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰信鑫瑞债券发起式 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	-1.11%	1.00%	2.26%	0.14%	-3.37%	0.86%
过去六个月	-2.49%	0.74%	2.63%	0.12%	-5.12%	0.62%
过去一年	-1.12%	0.52%	4.01%	0.11%	-5.13%	0.41%
过去三年	-0.39%	0.38%	15.13%	0.11%	-15.52%	0.27%
自基金合同生效起至今	-7.30%	0.35%	20.14%	0.11%	-27.44%	0.24%

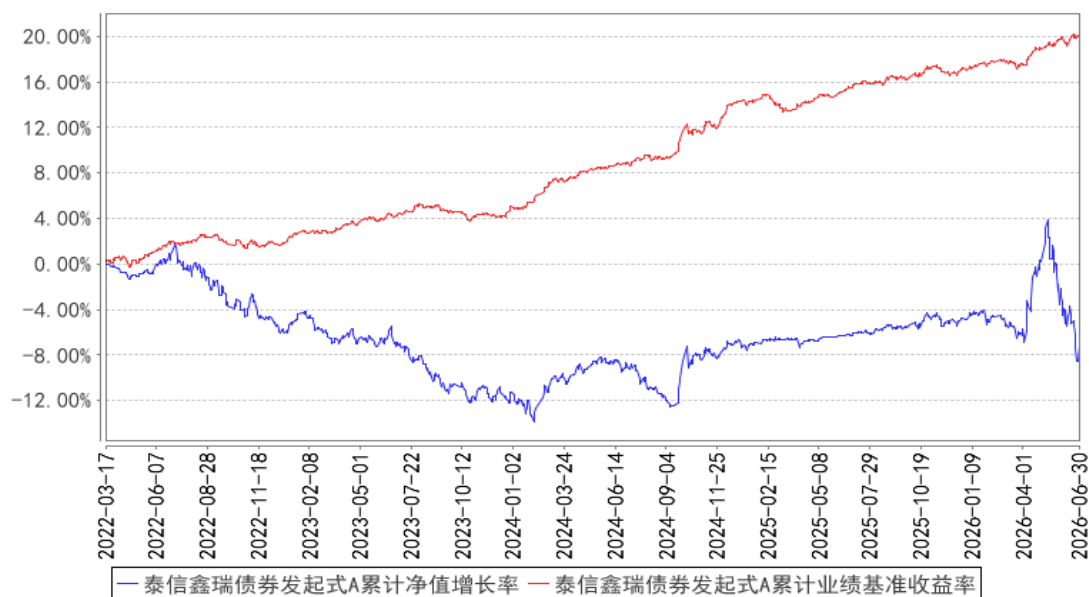
泰信鑫瑞债券发起式 C

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	-1.14%	0.99%	2.26%	0.14%	-3.40%	0.85%
过去六个月	-2.55%	0.73%	2.63%	0.12%	-5.18%	0.61%
过去一年	-1.22%	0.52%	4.01%	0.11%	-5.23%	0.41%
过去三年	-0.82%	0.38%	15.13%	0.11%	-15.95%	0.27%
自基金合同生效起至今	-7.81%	0.35%	20.14%	0.11%	-27.95%	0.24%

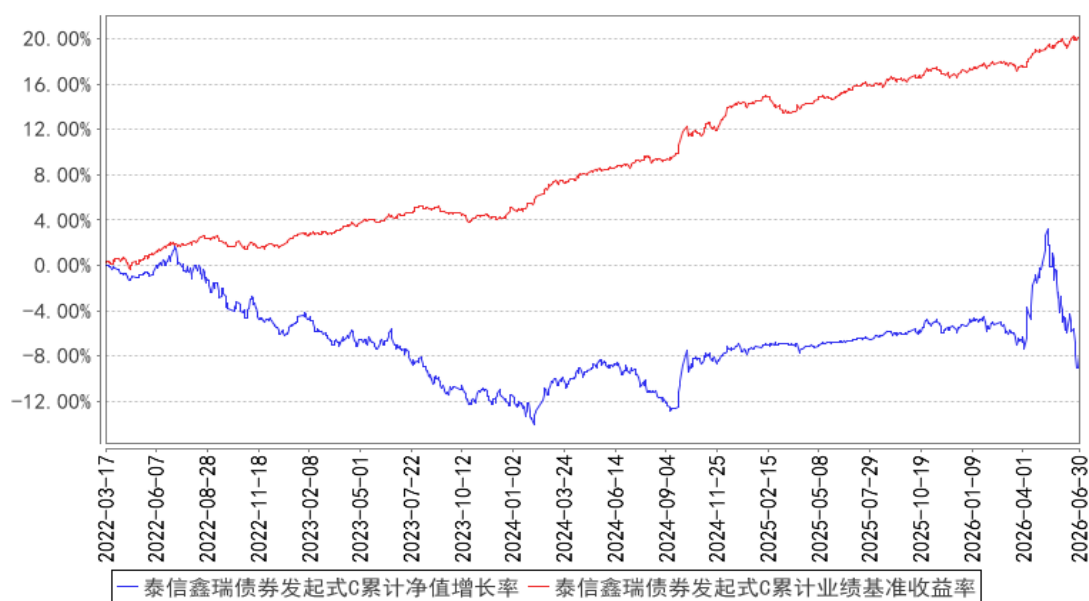
注：本基金业绩比较基准为：中证综合债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。

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

泰信鑫瑞债券发起式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



泰信鑫瑞债券发起式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 2022 年 3 月 17 日生效。

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%，股票的投资比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终应当保持现金或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 指数证券投资基金基金经理、泰	2025 年 1 月 9 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。
--	--	--	--	---

周庆	固收投资部总监、泰信添益 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理、泰信汇盈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	2025 年 10 月 23 日	-	10 年	周庆先生，研究生学历。曾任中国银行上海市分行金融机构部团队负责人岗位，财通证券资产管理有限公司固收私募投资部产品经理、固收研究部研究员、固收私募投资部投资经理助理、固收公募投资部高级经理、B 角、基金经理职务。2025 年 3 月加入泰信基金管理有限公司，曾任金融科技部联席总监，现任固收投资部总监兼集中交易部联席总监、基金经理，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，2025 年 10 月任泰信汇盈债券型证券投资基金基金经理，2025 年 10 月任泰信添益 90 天持有期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》、《泰信鑫瑞债券型发起式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。

股票投资和转债投资上，本基金依托量化多因子模型开展投资决策，全市场优选个股和转债，同时适度保持分散和行业均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信鑫瑞债券发起式 A 基金份额净值为 0.9270 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.49%；截止本报告期末泰信鑫瑞债券发起式 C 基金份额净值为 0.9219 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.55%；同期业绩比较基准收益率为 2.63%。

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、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

本报告期本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金管理人已向监管机构报送相关方案。

自 2026 年 5 月 7 日起至本报告期末，本基金产生的信息披露费用、审计费用、持有人大会费用、银行间账户维护费等相关固定费用，由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

§ 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人复核的财务指标、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：泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金

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	4,014.28	2,741,791.37
结算备付金		292,546.43	206,972.46
存出保证金		29,816.98	28,781.26
交易性金融资产	6.4.7.2	29,129,774.29	87,335,397.14
其中：股票投资		4,222,141.97	16,265,218.05
基金投资		-	-
债券投资		24,907,632.32	71,070,179.09
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	-	-
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		308,942.33	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,001,609.98	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		30,766,704.29	90,312,942.23
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		1,568,000.00	13,002,133.81
应付清算款		1,307,047.35	-
应付赎回款		1,335.57	-
应付管理人报酬		13,946.23	51,755.60
应付托管费		2,324.38	8,625.93
应付销售服务费		1,403.29	7,557.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		809.60	727.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	55,287.79	73,479.39
负债合计		2,950,154.21	13,144,279.57
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	30,108,439.31	81,510,842.65
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-2,291,889.23	-4,342,179.99
净资产合计		27,816,550.08	77,168,662.66
负债和净资产总计		30,766,704.29	90,312,942.23

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 30,108,439.31 份。其中：泰信鑫瑞债券发起式 A 份额净值人民币 0.9270 元，基金份额总额 11,728,329.34 份；泰信鑫瑞债券发起式 C 份额净值人民币 0.9219 元，基金份额总额 18,380,109.97 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-108,632.73	203,602.77
1. 利息收入		4,220.67	55,967.03
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,879.41	30,239.87
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		341.26	25,727.16
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,279,083.43	437,091.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-37,095.49	85,946.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,285,819.03	313,560.25
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	30,359.89	37,584.10
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	-1,392,678.13	-289,472.00
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	741.30	16.58
减：二、营业总支出		233,600.94	98,046.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	124,184.72	67,928.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,697.50	11,321.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,556.25	6,267.10
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		23,008.86	873.93
其中：卖出回购金融资产支出		23,008.86	873.93
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		406.21	133.50
8. 其他费用	6.4.7.19	50,747.40	11,521.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-342,233.67	105,556.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-342,233.67	105,556.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-342,233.67	105,556.60
----------	--	-------------	------------

6.3 净资产变动表

会计主体：泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金

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	81,510,842.65	-	-4,342,179.99	77,168,662.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	81,510,842.65	-	-4,342,179.99	77,168,662.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-51,402,403.34	-	2,050,290.76	-49,352,112.58
(一)、综合收益总额	-	-	-342,233.67	-342,233.67
(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)	-51,402,403.34	-	2,392,524.43	-49,009,878.91
其中：1. 基金申购款	25,416,615.70	-	-397,514.95	25,019,100.75
2. 基金赎回款	-76,819,019.04	-	2,790,039.38	-74,028,979.66
(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	30,108,439.31	-	-2,291,889.23	27,816,550.08

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	19,343,615.63	-	-1,349,575.05	17,994,040.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	19,343,615.63	-	-1,349,575.05	17,994,040.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,894,981.93	-	502,851.95	-5,392,129.98
(一)、综合收益总额	-	-	105,556.60	105,556.60
(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)	-5,894,981.93	-	397,295.35	-5,497,686.58
其中：1. 基金申购款	236,006,535.54	-	-16,351,768.08	219,654,767.46
2. 基金赎回款	- 241,901,517.47	-	16,749,063.43	-225,152,454.04
(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	13,448,633.70	-	-846,723.10	12,601,910.60

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：

李高峰

段晓旭

顾颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金(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[2021]第 2780 号《关于准予泰信鑫瑞债券型发起式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《泰信鑫瑞债券型发起式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 10,451,659.01 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(22)第 00139 号验资报告。《泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2022 年 3 月 17 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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信鑫瑞债券型发起式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、创业板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、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、公开发行的次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、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、货币市场工具等,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的相关规定。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%,股票的投资比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终应当保持现金或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证综合债指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%。

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 日起至 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

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	4,014.28
等于：本金	3,986.24
加：应计利息	28.04
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	4,014.28

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		5,193,557.62	-	4,222,141.97	-971,415.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	25,425,020.03	132,972.93	24,907,632.32	-650,360.64
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	25,425,020.03	132,972.93	24,907,632.32	-650,360.64
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		30,618,577.65	132,972.93	29,129,774.29	-1,621,776.29

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	13,940.39
其中：交易所市场	13,940.39
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	41,347.40
合计	55,287.79

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

泰信鑫瑞债券发起式 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	13,239,450.16	13,239,450.16
本期申购	1,479,221.70	1,479,221.70
本期赎回（以“-”号填列）	-2,990,342.52	-2,990,342.52
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	11,728,329.34	11,728,329.34

泰信鑫瑞债券发起式 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	68,271,392.49	68,271,392.49
本期申购	23,937,394.00	23,937,394.00
本期赎回（以“-”号填列）	-73,828,676.52	-73,828,676.52
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	18,380,109.97	18,380,109.97

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

泰信鑫瑞债券发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-893,989.07	241,104.86	-652,884.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-893,989.07	241,104.86	-652,884.21
本期利润	496,456.06	-760,283.10	-263,827.04
本期基金份额交易产生的变动数	106,939.23	-46,156.89	60,782.34

其中：基金申购款	-86,681.17	33,915.09	-52,766.08
基金赎回款	193,620.40	-80,071.98	113,548.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-290,593.78	-565,335.13	-855,928.91

泰信鑫瑞债券发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,930,501.71	1,241,205.93	-3,689,295.78
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-4,930,501.71	1,241,205.93	-3,689,295.78
本期利润	553,988.40	-632,395.03	-78,406.63
本期基金份额交易产生的变动数	3,820,392.51	-1,488,650.42	2,331,742.09
其中：基金申购款	-756,561.89	411,813.02	-344,748.87
基金赎回款	4,576,954.40	-1,900,463.44	2,676,490.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-556,120.80	-879,839.52	-1,435,960.32

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	3,399.27
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	422.91
其他	57.23
合计	3,879.41

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	-37,095.49
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	-37,095.49

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	32,049,472.57
减：卖出股票成本总额	32,043,488.87
减：交易费用	43,079.19
买卖股票差价收入	-37,095.49

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1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	234,851.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,050,967.74
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	1,285,819.03

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1月1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	174,339,982.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	172,118,967.53
减：应计利息总额	1,160,658.73
减：交易费用	9,388.06
买卖债券差价收入	1,050,967.74

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	30,359.89
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	30,359.89

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	-1,392,678.13
股票投资	-976,839.10
债券投资	-415,839.03
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	-1,392,678.13

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	738.34
基金转换费收入	2.96
合计	741.30

注：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。

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	10,170.32

信息披露费	27,616.68
证券出借违约金	-
账户维护费	12,560.40
其他	400.00
合计	50,747.40

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
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	124,184.72	67,928.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	44,181.06	6,950.18
应支付基金管理人的净管理费	80,003.66	60,978.22

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×0.60%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=前一日基金资产净值×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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	20,697.50	11,321.35

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		
	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C	合计
泰信基金管理有限公司	—	0.14	0.14
平安银行	—	13,875.67	13,875.67
合计	—	13,875.81	13,875.81
	上年度可比期间		

获得销售服务费的各关联方名称	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	2,468.24	2,468.24
平安银行	-	5.43	5.43
合计	-	2,473.67	2,473.67

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 0.10%。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×0.10%÷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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C
报告期初持有的基金份额	10,001,261.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	10,001,261.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	33.22%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C
报告期初持有的基金份额	10,001,261.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	10,001,261.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	74.37%	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的费用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

份额单位：份

泰信鑫瑞债券发起式 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
上海锐懿资产管理有限公司	1,612,939.80	5.36	1,612,939.80	1.98

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	4,014.28	3,399.27	172,440.43	29,020.69

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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
688121	*ST 卓然	2026 年 5 月 6 日	无法在法定期限内披露 2025 年年度报告	6.48	2026 年 07 月 07 日	5.18	3,202	30,935.76	20,748.96	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,568,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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平安银行，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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	5,069,621.10
合计	-	5,069,621.10

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，未评级债券列示超短期融资债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	1,131,959.37
AAA 以下	23,290,844.59	1,470,673.92
未评级	-	-

合计	23,290,844.59	2,602,633.29
----	---------------	--------------

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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 0.0746%。

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 28,721,255.38 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	4,014.28	-	-	-	4,014.28
结算备付金	292,546.43	-	-	-	292,546.43
存出保证金	29,816.98	-	-	-	29,816.98
交易性金融资产	4,993,939.69	19,913,692.63	-	4,222,141.97	29,129,774.29
应收申购款	-	-	-	1,001,609.98	1,001,609.98
应收清算款	-	-	-	308,942.33	308,942.33

资产总计	5,320,317.38	19,913,692.63	-	5,532,694.28	30,766,704.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,335.57	1,335.57
应付管理人报酬	-	-	-	13,946.23	13,946.23
应付托管费	-	-	-	2,324.38	2,324.38
应付清算款	-	-	-	1,307,047.35	1,307,047.35
卖出回购金融资产款	1,568,000.00	-	-	-	1,568,000.00
应付销售服务费	-	-	-	1,403.29	1,403.29
应交税费	-	-	-	809.60	809.60
其他负债	-	-	-	55,287.79	55,287.79
负债总计	1,568,000.00	-	-	1,382,154.21	2,950,154.21
利率敏感度缺口	3,752,317.38	19,913,692.63	-	4,150,540.07	27,816,550.08
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	2,741,791.37	-	-	-	2,741,791.37
结算备付金	206,972.46	-	-	-	206,972.46
存出保证金	28,781.26	-	-	-	28,781.26
交易性金融资产	43,241,965.84	16,487,036.01	11,341,177.24	16,265,218.05	87,335,397.14
资产总计	46,219,510.93	16,487,036.01	11,341,177.24	16,265,218.05	90,312,942.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	51,755.60	51,755.60
应付托管费	-	-	-	8,625.93	8,625.93
卖出回购金融资产款	13,002,133.81	-	-	-	13,002,133.81
应付销售服务费	-	-	-	7,557.79	7,557.79
应交税费	-	-	-	727.05	727.05
其他负债	-	-	-	73,479.39	73,479.39
负债总计	13,002,133.81	-	-	142,145.76	13,144,279.57
利率敏感度缺口	33,217,377.12	16,487,036.01	11,341,177.24	16,123,072.29	77,168,662.66

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）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）

	1. 市场利率上升 25个基点	-150,357.54	-561,048.38
	2. 市场利率下降 25个基点	151,987.32	568,154.89

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	4,222,141.97	15.18	16,265,218.05	21.08
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	4,222,141.97	15.18	16,265,218.05	21.08

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%	204,461.77	3,624,377.51

	2. 业绩比较基准下 降 5%	-204, 461. 77	-3, 624, 377. 51
--	--------------------	---------------	------------------

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

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	27, 492, 237. 60	18, 786, 035. 34
第二层次	1, 637, 536. 69	68, 549, 361. 80
第三层次	-	-
合计	29, 129, 774. 29	87, 335, 397. 14

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	4,222,141.97	13.72
	其中：股票	4,222,141.97	13.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,907,632.32	80.96
	其中：债券	24,907,632.32	80.96
	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	296,560.71	0.96
8	其他各项资产	1,340,369.29	4.36
9	合计	30,766,704.29	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	66,329.00	0.24
B	采矿业	27,717.00	0.10
C	制造业	2,747,942.00	9.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,696.00	0.17
E	建筑业	52,645.00	0.19
F	批发和零售业	188,117.00	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	68,199.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	344,172.45	1.24

J	金融业	-	-
K	房地产业	54,951.00	0.20
L	租赁和商务服务业	30,786.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	191,848.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	165,118.52	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	78,593.00	0.28
Q	卫生和社会工作	90,763.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	68,265.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	4,222,141.97	15.18

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	002760	风形股份	3,000	49,260.00	0.18
2	688701	卓锦股份	6,484	48,824.52	0.18
3	600831	广电网络	16,100	48,139.00	0.17
4	300838	浙江力诺	3,600	48,060.00	0.17
5	301130	西点药业	2,000	47,960.00	0.17
6	603908	牧高笛	2,800	47,264.00	0.17
7	300694	蠡湖股份	4,900	47,040.00	0.17
8	600149	廊坊发展	10,400	46,696.00	0.17
9	000637	茂化实华	13,300	46,550.00	0.17
10	002591	恒大高新	7,600	46,512.00	0.17
11	600807	济高发展	19,800	46,332.00	0.17
12	600455	博通股份	2,100	46,116.00	0.17
13	002622	皓宸医疗	22,100	45,747.00	0.16
14	301298	东利机械	3,900	45,123.00	0.16
15	002524	光正眼科	13,600	45,016.00	0.16
16	603073	彩蝶实业	3,000	44,730.00	0.16
17	300707	威唐工业	4,000	44,720.00	0.16
18	688393	安必平	2,500	44,450.00	0.16
19	688565	力源科技	4,700	44,415.00	0.16
20	300176	鸿特科技	8,900	43,165.00	0.16
21	002999	天禾股份	7,600	40,432.00	0.15
22	688329	艾隆科技	2,000	40,420.00	0.15
23	300030	阳普医疗	6,700	38,927.00	0.14
24	600697	欧亚集团	4,000	38,880.00	0.14

25	000702	正虹科技	7,800	38,688.00	0.14
26	300535	达威股份	2,800	38,164.00	0.14
27	300112	万讯自控	6,100	37,759.00	0.14
28	600706	曲江文旅	5,600	37,688.00	0.14
29	003042	中农联合	3,100	37,665.00	0.14
30	001260	坤泰股份	2,400	37,560.00	0.14
31	301336	趣睡科技	940	37,553.00	0.14
32	603214	爱婴室	3,100	37,541.00	0.13
33	300220	金运激光	3,600	37,404.00	0.13
34	600778	友好集团	7,600	37,164.00	0.13
35	000995	皇台酒业	3,900	37,050.00	0.13
36	688670	金迪克	2,152	36,454.88	0.13
37	002809	红墙股份	4,800	35,712.00	0.13
38	002343	慈文传媒	7,900	34,444.00	0.12
39	000757	浩物股份	10,000	34,100.00	0.12
40	688092	爱科科技	1,600	33,984.00	0.12
41	300886	华业香料	1,700	33,830.00	0.12
42	002858	力盛体育	3,100	33,821.00	0.12
43	603879	永悦科技	7,300	32,996.00	0.12
44	600661	昂立教育	4,700	32,477.00	0.12
45	688659	元琛科技	3,103	32,395.32	0.12
46	603182	嘉华股份	2,800	31,920.00	0.11
47	300645	正元智慧	2,700	31,779.00	0.11
48	300074	华平股份	9,300	31,620.00	0.11
49	603860	中公高科	1,300	31,447.00	0.11
50	000633	合金投资	6,600	31,416.00	0.11
51	688638	誉辰智能	1,000	31,170.00	0.11
52	300405	科隆股份	6,000	31,080.00	0.11
53	300614	百川畅银	3,200	30,976.00	0.11
54	300640	德艺文创	5,500	30,965.00	0.11
55	688681	科汇股份	2,214	30,951.72	0.11
56	688078	龙软科技	1,449	30,501.45	0.11
57	301359	东南电子	1,900	30,172.00	0.11
58	000856	冀东装备	4,200	30,030.00	0.11
59	300500	启迪设计	3,400	30,022.00	0.11
60	300514	友讯达	3,200	29,920.00	0.11
61	688217	睿昂基因	1,431	29,564.46	0.11
62	300612	宣亚国际	2,700	29,511.00	0.11
63	603183	建研院	8,300	29,465.00	0.11
64	002188	中天服务	6,000	29,400.00	0.11
65	002873	新天药业	4,000	29,280.00	0.11
66	603168	莎普爱思	6,200	29,264.00	0.11
67	002715	登云股份	2,200	29,150.00	0.10

68	300923	研奥股份	1,300	28,964.00	0.10
69	688118	普元信息	1,420	28,570.40	0.10
70	002820	桂发祥	3,400	28,560.00	0.10
71	301063	海锅股份	1,700	28,492.00	0.10
72	002743	富煌钢构	7,300	28,178.00	0.10
73	688296	和达科技	2,462	28,165.28	0.10
74	301515	港通医疗	1,600	28,048.00	0.10
75	600883	博闻科技	4,000	28,000.00	0.10
76	600303	曙光股份	11,200	27,888.00	0.10
77	301098	金埔园林	3,400	27,880.00	0.10
78	600202	哈空调	6,200	27,776.00	0.10
79	688089	嘉必优	2,606	27,649.66	0.10
80	002144	宏达高科	2,800	27,580.00	0.10
81	688528	秦川物联	3,016	27,566.24	0.10
82	002817	黄山胶囊	4,700	27,542.00	0.10
83	688067	爱威科技	1,364	27,484.60	0.10
84	301355	南王科技	2,800	27,384.00	0.10
85	003008	开普检测	1,600	27,312.00	0.10
86	688004	博汇科技	1,470	26,754.00	0.10
87	002629	仁智股份	6,200	26,660.00	0.10
88	002494	华斯股份	6,000	26,640.00	0.10
89	300169	天晟新材	5,300	26,447.00	0.10
90	300929	华骐环保	2,500	26,350.00	0.09
91	688695	中创股份	1,400	26,180.00	0.09
92	300549	优德精密	2,000	26,040.00	0.09
93	688021	奥福科技	1,345	26,039.20	0.09
94	301167	建研设计	2,100	26,019.00	0.09
95	300240	飞力达	5,200	25,948.00	0.09
96	003003	天元股份	2,600	25,870.00	0.09
97	600235	民丰特纸	5,200	25,844.00	0.09
98	002495	佳隆股份	12,600	25,830.00	0.09
99	688793	倍轻松	1,600	25,776.00	0.09
100	301131	聚赛龙	800	25,704.00	0.09
101	600493	凤竹纺织	4,900	25,676.00	0.09
102	688573	信宇人	1,448	25,658.56	0.09
103	300417	南华仪器	2,500	25,650.00	0.09
104	688420	美腾科技	1,216	25,621.12	0.09
105	603717	天域生物	4,400	25,476.00	0.09
106	002247	聚力文化	12,000	25,320.00	0.09
107	688058	宝兰德	1,206	25,229.52	0.09
108	300605	恒锋信息	2,700	24,948.00	0.09
109	300675	建科院	2,100	24,885.00	0.09
110	603022	新通联	3,100	24,769.00	0.09

111	300621	维业股份	3,900	24,765.00	0.09
112	600099	林海股份	3,100	24,738.00	0.09
113	002133	广宇集团	10,300	24,617.00	0.09
114	002486	嘉麟杰	11,500	24,610.00	0.09
115	600448	华纺股份	9,700	24,444.00	0.09
116	603818	曲美家居	8,200	24,354.00	0.09
117	600137	浪莎股份	1,500	24,345.00	0.09
118	600561	江西长运	4,900	24,255.00	0.09
119	605567	春雪食品	3,000	23,970.00	0.09
120	603029	天鹅股份	1,700	23,902.00	0.09
121	301010	晶雪节能	1,400	22,806.00	0.08
122	300126	锐奇股份	3,800	21,964.00	0.08
123	300597	吉大通信	3,100	21,948.00	0.08
124	300958	建工修复	2,000	21,280.00	0.08
125	603385	惠达卫浴	4,300	20,984.00	0.08
126	688121	*ST 卓然	3,202	20,748.96	0.07
127	600371	万向德农	3,300	20,625.00	0.07
128	600097	开创国际	2,600	20,228.00	0.07
129	001336	楚环科技	900	19,818.00	0.07
130	300635	中达安	1,600	19,472.00	0.07
131	300513	恒实科技	2,600	18,824.00	0.07
132	000548	湖南投资	4,400	17,996.00	0.06
133	603709	中源家居	1,100	14,894.00	0.05
134	002105	信隆健康	2,300	11,362.00	0.04
135	002205	国统股份	1,100	11,099.00	0.04
136	002535	林州重机	2,000	4,400.00	0.02
137	688288	鸿泉技术	225	3,998.25	0.01
138	301390	经纬股份	100	3,226.00	0.01
139	688026	洁特生物	163	2,560.73	0.01
140	300717	华信新材	100	2,130.00	0.01
141	003011	海象新材	100	1,817.00	0.01
142	600671	天目药业	100	1,688.00	0.01
143	688038	中科通达	90	1,513.80	0.01
144	600768	宁波富邦	100	1,498.00	0.01
145	603282	亚光股份	100	1,427.00	0.01
146	600444	国机通用	100	1,298.00	0.00
147	300947	德必集团	100	1,275.00	0.00
148	603700	宁水集团	100	1,161.00	0.00
149	002910	庄园牧场	100	1,108.00	0.00
150	002828	贝肯能源	100	1,057.00	0.00
151	300665	飞鹿股份	100	1,023.00	0.00
152	688193	仁度生物	17	940.10	0.00
153	603506	南都物业	100	934.00	0.00

154	600615	鑫源智造	100	924.00	0.00
155	300670	大烨智能	100	706.00	0.00
156	300883	龙利得	100	631.00	0.00
157	002687	乔治白	100	524.00	0.00
158	000955	欣龙控股	100	439.00	0.00
159	002084	海鸥住工	100	348.00	0.00
160	688056	莱伯泰科	4	258.20	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	688256	寒武纪	251,755.68	0.33
2	002715	登云股份	237,028.00	0.31
3	603993	洛阳钼业	204,786.00	0.27
4	300308	中际旭创	185,598.00	0.24
5	600303	曙光股份	181,204.00	0.23
6	600111	北方稀土	171,577.00	0.22
7	603717	天域生物	168,184.00	0.22
8	300476	胜宏科技	154,207.00	0.20
9	601211	国泰海通	152,862.00	0.20
10	002371	北方华创	147,611.00	0.19
11	002591	恒大高新	147,358.00	0.19
12	600768	宁波富邦	145,731.00	0.19
13	601600	中国铝业	131,730.00	0.17
14	300670	大烨智能	131,632.00	0.17
15	688701	卓锦股份	130,298.77	0.17
16	002760	凤形股份	127,953.00	0.17
17	603908	牧高笛	126,743.00	0.16
18	300112	万讯自控	125,719.00	0.16
19	600276	恒瑞医药	123,170.00	0.16
20	002594	比亚迪	121,800.00	0.16

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	300750	宁德时代	1,320,998.00	1.71
2	600519	贵州茅台	1,145,053.00	1.48
3	601899	紫金矿业	927,546.00	1.20

4	300308	中际旭创	657,417.00	0.85
5	002594	比亚迪	604,879.00	0.78
6	600036	招商银行	584,632.00	0.76
7	601288	农业银行	515,371.00	0.67
8	000333	美的集团	499,134.00	0.65
9	600900	长江电力	499,001.00	0.65
10	601398	工商银行	486,879.00	0.63
11	688256	寒武纪	485,105.92	0.63
12	601857	中国石油	434,812.00	0.56
13	000858	五粮液	422,698.00	0.55
14	601138	工业富联	408,942.00	0.53
15	603993	洛阳钼业	404,517.00	0.52
16	002475	立讯精密	372,660.00	0.48
17	601166	兴业银行	359,778.00	0.47
18	601088	中国神华	340,811.00	0.44
19	600150	中国船舶	326,762.00	0.42
20	601816	京沪高铁	296,135.00	0.38

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	20,977,251.89
卖出股票收入（成交）总额	32,049,472.57

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	1,616,787.73	5.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	23,290,844.59	83.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,907,632.32	89.54

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	019792	25 国债 19	16,000	1,616,787.73	5.81
2	118011	银微转债	2,950	589,050.58	2.12
3	118016	京源转债	2,430	500,231.48	1.80
4	123187	超达转债	2,350	497,023.39	1.79
5	123178	花园转债	2,930	485,631.85	1.75

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

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

本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

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。

7.11.2 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	29,816.98
2	应收清算款	308,942.33
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,001,609.98

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,340,369.29

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118011	银微转债	589,050.58	2.12
2	118016	京源转债	500,231.48	1.80
3	123187	超达转债	497,023.39	1.79
4	123178	花园转债	485,631.85	1.75
5	118036	力合转债	471,993.73	1.70
6	128128	齐翔转2	470,510.01	1.69
7	123251	华医转债	466,747.46	1.68
8	118040	宏微转债	465,602.86	1.67
9	118044	赛特转债	456,686.82	1.64
10	127078	优彩转债	454,014.89	1.63
11	113694	清源转债	453,300.48	1.63
12	113665	汇通转债	452,747.97	1.63
13	128134	鸿路转债	449,955.03	1.62
14	110076	华海转债	447,806.37	1.61
15	113655	欧22转债	442,842.29	1.59
16	113658	密卫转债	441,913.71	1.59
17	123188	水羊转债	439,069.61	1.58
18	123157	科蓝转债	438,470.97	1.58
19	118031	天23转债	436,801.32	1.57
20	113597	佳力转债	434,789.48	1.56
21	110084	贵燃转债	434,105.99	1.56
22	127103	东南转债	430,746.36	1.55
23	123144	裕兴转债	424,804.82	1.53
24	113681	镇洋转债	412,311.78	1.48
25	113054	绿动转债	386,593.93	1.39
26	113691	和邦转债	382,993.89	1.38
27	123172	漱玉转债	381,826.08	1.37
28	123183	海顺转债	362,708.71	1.30
29	113624	正川转债	362,177.05	1.30
30	110095	双良转债	359,075.34	1.29
31	123149	通裕转债	347,546.49	1.25
32	127040	国泰转债	347,432.59	1.25
33	127105	龙星转债	345,323.74	1.24
34	123142	申昊转债	345,284.14	1.24
35	118024	冠宇转债	344,266.58	1.24
36	127089	晶澳转债	342,015.46	1.23

37	123207	冠中转债	327,451.86	1.18
38	127082	亚科转债	327,321.05	1.18
39	123171	共同转债	317,118.83	1.14
40	123253	永贵转债	305,450.36	1.10
41	113661	福 22 转债	296,559.54	1.07
42	113605	大参转债	294,159.60	1.06
43	128127	文科转债	286,406.77	1.03
44	118007	山石转债	283,744.59	1.02
45	123215	铭利转债	282,718.51	1.02
46	113632	鹤 21 转债	279,503.70	1.00
47	118034	晶能转债	278,299.91	1.00
48	123216	科顺转债	277,563.67	1.00
49	111015	东亚转债	277,493.96	1.00
50	113058	友发转债	273,378.37	0.98
51	127034	绿茵转债	272,746.11	0.98
52	127102	浙建转债	269,298.75	0.97
53	110097	天润转债	268,451.70	0.97
54	127099	盛航转债	252,127.06	0.91
55	113695	华辰转债	232,267.84	0.83
56	110098	南药转债	226,001.85	0.81
57	123150	九强转债	223,721.47	0.80
58	123237	佳禾转债	198,934.80	0.72
59	113659	莱克转债	189,192.44	0.68
60	123088	威唐转债	168,163.13	0.60
61	113680	丽岛转债	129,752.75	0.47
62	113649	丰山转债	128,580.61	0.46
63	128125	华阳转债	128,430.18	0.46
64	123225	翔丰转债	126,726.36	0.46
65	118035	国力转债	118,581.90	0.43
66	111020	合顺转债	116,595.85	0.42
67	113678	中贝转债	115,477.43	0.42
68	111004	明新转债	112,566.82	0.40
69	127095	广泰转债	80,818.56	0.29
70	127067	恒逸转 2	71,409.80	0.26
71	113631	皖天转债	70,938.25	0.26
72	123224	宇邦转债	65,742.40	0.24
73	123222	博俊转债	63,148.50	0.23
74	123064	万孚转债	62,008.23	0.22
75	123243	严牌转债	59,430.60	0.21
76	111017	蓝天转债	51,445.79	0.18
77	111018	华康转债	50,542.65	0.18
78	127108	太能转债	26,168.79	0.09

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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 (%)
泰信鑫瑞 债券发起 式 A	53	221,289.23	11,614,200.94	99.03	114,128.40	0.97
泰信鑫瑞 债券发起 式 C	196	93,776.07	0.00	0.00	18,380,109.97	100.00
合计	249	120,917.43	11,614,200.94	38.57	18,494,238.37	61.43

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 （%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	泰信鑫瑞债券发起式 A	107.52	0.0009
	泰信鑫瑞债券发起式 C	30.73	0.0002
	合计	138.25	0.0005

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	泰信鑫瑞债券发起式 A	0
	泰信鑫瑞债券发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有	泰信鑫瑞债券发起式 A	0

本开放式基金	泰信鑫瑞债券发起式 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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,261.14	33.22	10,001,261.14	33.22	自基金合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,261.14	33.22	10,001,261.14	33.22	自基金合同生效之日起不少于 3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信鑫瑞债券发起式 A	泰信鑫瑞债券发起式 C
基金合同生效日（2022 年 3 月 17 日）基金份额总额	10,138,447.87	313,211.14
本报告期期初基金份额总额	13,239,450.16	68,271,392.49
本报告期基金总申购份额	1,479,221.70	23,937,394.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,990,342.52	73,828,676.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	11,728,329.34	18,380,109.97

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、2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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，本基金托管人的托管业务部门无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，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无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(%)	
国盛证券	2	53,026,724.46	100.00	23,648.27	100.00	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	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(%)
国盛证券	251,938,577.48	100.00	146,907,000.00	100.00	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

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	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金 2025 年第四季度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 21 日
2	泰信基金管理有限公司高级管理人	规定报刊及规定网站	2026 年 2 月 10 日

	员变更公告		
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	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金招募说明书更新（2026 年 1 号）及产品资料概要	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 17 日
5	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 30 日
6	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
7	泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金 2026 年第一季度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 21 日
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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260303-20260630	10,001,261.14	0.00	0.00	10,001,261.14	33.22
个人	1	20260420-20260422	5,292,125.32	0.00	0.00	5,292,125.32	17.58
	2	20260506-20260506	5,292,125.32	0.00	0.00	5,292,125.32	17.58
	3	20260508-20260520	5,292,125.32	0.00	0.00	5,292,125.32	17.58
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信鑫瑞债券型发起式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