

# 泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1. 1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	9
4.1 基金经理及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
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	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
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	43

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 .....	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.11 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</b>
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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金	
基金简称	泰信添安增利九个月持有期债券	
基金主代码	020746	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 6 月 7 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	59,564,424.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰信添安增利九个月持有期债券 A	泰信添安增利九个月持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	020746	020747
报告期末下属分级基金的份额总额	12,799,097.14 份	46,765,327.77 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，形成对各大类资产的预测和判断，并根据市场运行状况以及各类资产预期表现的相对变化，动态调整大类资产的配置比例，严格控制基金资产运作风险，提高基金资产风险调整后收益。本基金采取的投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、回购策略和流动性管理策略等。
业绩比较基准	中债新综合财富指数收益率×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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘小舫
	联系电话	021-20899003
	电子邮箱	xxpl@ftfund.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	中国（上海）长宁区仙霞路 18

	东南路 256 号 36-37 层	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	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区浦东南路 256 号 36、37 层
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

## § 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	泰信添安增利九个月持有期债券 A	泰信添安增利九个月持有期债券 C
本期已实现收益	129,894.91	850,065.16
本期利润	144,772.19	561,691.81
加权平均基金份额本期利润	0.0107	0.0049
本期加权平均净值利润率	1.05%	0.49%
本期基金份额净值增长率	1.10%	0.95%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	307,150.20	969,767.93
期末可供分配基金份额利润	0.0240	0.0207
期末基金资产净值	13,114,429.13	47,764,923.66

期末基金份额净值	1.0246	1.0214
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.46%	2.14%

注：1、本基金基金合同于 2024 年 6 月 7 日正式生效。

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

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

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰信添安增利九个月持有期债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.73%	0.09%	0.70%	0.05%	0.03%	0.04%
过去三个月	0.78%	0.20%	1.67%	0.08%	-0.89%	0.12%
过去六个月	1.10%	0.14%	1.01%	0.10%	0.09%	0.04%
过去一年	2.38%	0.10%	5.89%	0.13%	-3.51%	-0.03%
自基金合同生效起至今	2.46%	0.10%	6.10%	0.13%	-3.64%	-0.03%

泰信添安增利九个月持有期债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.70%	0.09%	0.70%	0.05%	0.00%	0.04%
过去三个月	0.71%	0.20%	1.67%	0.08%	-0.96%	0.12%
过去六个月	0.95%	0.14%	1.01%	0.10%	-0.06%	0.04%
过去一年	2.08%	0.10%	5.89%	0.13%	-3.81%	-0.03%
自基金合同生效起至今	2.14%	0.10%	6.10%	0.13%	-3.96%	-0.03%

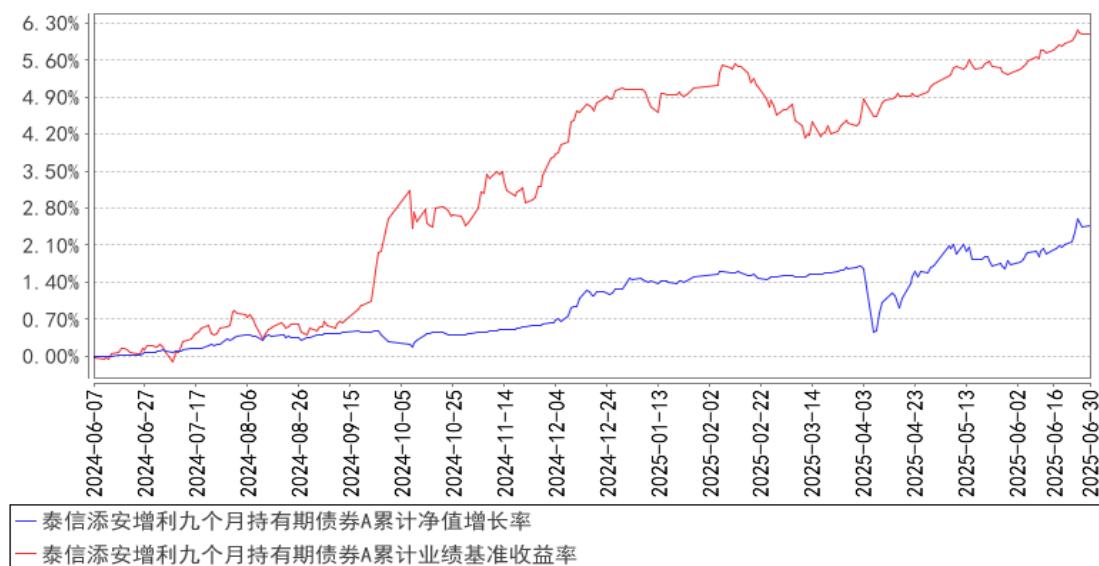
起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准为：中债新综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%

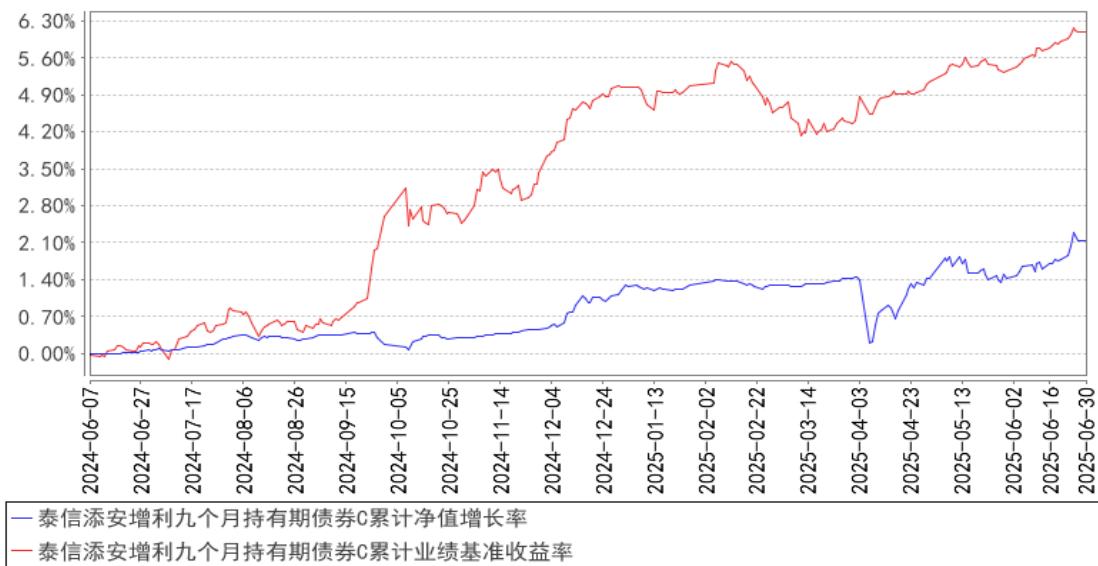
- 1、中债新综合财富（总值）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，为中国全市场债券指数。其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，具有广泛的市场代表性。
- 2、沪深 300 指数由上海和深圳证券市场中市值大、流动性好的 300 只股票组成，覆盖了大部分流通市值，能够反映 A 股市场上股票价格的整体表现。本基金的业绩比较基准根据基金投资风格和策略特点设置，能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰信添安增利九个月持有期债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



**泰信添安增利九个月持有期债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：1、本基金基金合同于 2024 年 6 月 7 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、可转换债券（含可分离交易可转债）和可交换债券的投资比例合计不超过基金资产的 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 2025 年 6 月末，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+主题混合、泰信智选成长灵活配置混合、泰信鑫利混合、泰信竞争优选混合、泰信景气驱动 12 个月持有期混合、泰信低碳经济混合发起式、泰信均衡价值混合、泰信汇利三个定开债券、泰信医疗服务混合发起式、泰信添利 30 天持有期债券发起式、泰信鑫瑞债券发起式、泰信汇盈债券、泰信优势领航混合、泰信添鑫中短债债券、泰信汇鑫三个月定开债券、泰信添益 90 天持有期债券、泰信添安增利九个月持有期债券、泰信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期、泰信智选量化选股混合发起式共 35 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		
张安格	泰信鑫利混合型证券投资基金管理人、泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金管理人、泰信鑫瑞债券型发	2024 年 7 月 27 日	-	10 年	张安格女士，研究生学历。曾任职于申万宏源证券有限公司资产管理事业部，从事固定收益类产品的设计、交易、研究及投资。2020 年 12 月加入泰信基金管理有限公司拟任基金经理。2021 年 2 月任泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至 2023 年 11 月任泰信汇享利率债债券型证券投资基金基金经理，2022 年 3 月任泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金管理人，2022 年 3 月任泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金管理人，2022 年 3 月任泰信汇盈债券型证券投资基金基金经理，2022 年 10 月

起式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、泰信汇鑫三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理、泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金经理				任泰信汇鑫三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2024 年 7 月任泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理，2024 年 7 月任泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金经理。
-------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理办法》、《泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易部集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，根据投资交易监控与价差分析情况，未发现基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格执行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。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。

## 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

2025年上半年，国内经济运行平稳，尽管有关税的冲击，但GDP增长仍略超预期。CPI、PPI总体仍处于负增长区间，社会总需求仍具有较大的改善空间。分结构来看，新经济及高端制造业表现较好，传统制造业仍面临价格和盈利的压力；大型企业较小型企业展现出更强的经营韧性和更乐观的运营信心。在全球经济面临关税扰动及未来预期不确定性增加的背景下，上半年国内仍坚定而稳妥地进行着经济结构的调整，从问题的根源出发，积极推动消费尤其是内需的增长，以改善经济增长模式；并旗帜鲜明地提出反内卷理念，纠正无序竞争，努力推动生产和消费价格的企稳回升，以期推动CPI、PPI重回合理增长区间。

上半年权益市场热点较多，轮动明显。年初Deepseek、机器人等硬科技的亮相带动产业链相关公司股价明显上涨，并带动市场风险偏好有所回升。契合年轻人喜好的潮玩消费、宠物经济，以及金价上涨背景下的黄金珠宝新风尚消费等概念也表现亮眼。受海外BD事件不断催化的创新药企业在经历了估值长期调整后迎来了股价上涨。而另一边，以银行为代表的红利股则在低利率环境下不断获得长线资金的青睐，股价稳步上涨。受益于整个权益市场信心的改善及风险偏好的提升，部分低位周期股也开始出现资金进场布局、静待反转的迹象。

债券市场在2025年上半年一波三折。首先是年初资金面的收紧带动中短端债券利率上行，长

久期债券起初虽调整不多，但期限利差和资金利差已然极度逼仄，调整压力积聚。随后，在权益市场回暖的背景下，长端利率债的多头阵营瓦解，出现明显调整。待债券的估值风险释放后，央行及时出手，呵护银行间市场流动性、平抑资金价格，带动债券收益率下行。4月初。突如其来的关税挑战瞬间点燃债市做多情绪，债券收益率在短短两三个交易日内大幅下行，随后进入窄幅震荡区间。

2025年上半年，本基金逐步增持权益类资产，降低纯债类资产的占比，股票部分主要以均衡成长风格为主，债券部分则逐步降低信用债持仓，以利率债持仓为主，增加利率债波段交易。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信添安增利九个月持有期债券 A 基金份额净值为 1.0246 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.10%；截止本报告期末泰信添安增利九个月持有期债券 C 基金份额净值为 1.0214 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.95%；同期业绩比较基准收益率为 1.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为低利率时代，纯债类资产能够提供的静态收益率较低，更多的需要投资者通过波段交易去获取资本利得。但交易本身也是双刃剑，可能会放大投资组合的净值波动，因此在未来一段时间内，我们很可能会看到债券投资组合的收益风险比弱于历史表现。在这样的背景下，多资产的组合就显得尤为重要，可以在一定程度上优化投资组合的收益风险比。我们认为，未来权益类资产的表现更值得期待。一方面，我们认为经济基本面有韧性，国内经济总量在政策的支持下增长有保障。且当前反内卷等政策的出台直击问题根源，能够改善经济运行效率，带动行业优胜劣汰，在整体层面实现企业盈利能力的优化，这对于上市企业的股价将形成正面影响。另一方面，从资产比价的角度来看，权益类资产的估值性价比更高，伴随着投资者教育的普及和风险偏好的逐步提升，我们认为在未来一段时间内，居民财富很可能会从低风险资产向以权益类资产为代表风险资产做适当转移，这一趋势也将促使权益资产的价格表现更好。而在股票市场的内部结构方面，我们认为三大类标的有望呈现较好的表现，一是能够吸引长线资金做底仓配置的红利价值股；二是能够实现技术突破、契合最新科技发展趋势的从事先进生产的企业；三是经历过长期调整，估值处于低位，基本面可能迎来反转的部分周期类企业。

#### 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、通过红利再投资所得基金份额的最短持有期不重新计算，按原基金份额（通过认购/申购/转换转入所得的份额）的最短持有期计算；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

##### 二、本报告期本基金未进行利润分配。

#### 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

本基金于 2025 年 3 月 19 日至 2025 年 5 月 27 日有连续二十个工作日基金资产净值低于五千元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，泰信基金管理有限公司在泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由泰信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2025年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	394,460.50	179,579.54
结算备付金		246,438.92	-
存出保证金		20,386.25	-
交易性金融资产	6.4.7.2	57,288,793.21	262,238,772.06
其中：股票投资		7,735,299.20	-
基金投资		-	-
债券投资		49,553,494.01	262,238,772.06
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	3,200,000.00	20,008,416.40
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		629,624.42	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 5	-	-
资产总计		61, 779, 703. 30	282, 426, 768. 00
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>			
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		250, 084. 94	-
应付赎回款		508, 666. 21	-
应付管理人报酬		18, 786. 11	95, 257. 85
应付托管费		2, 817. 93	14, 288. 69
应付销售服务费		10, 771. 92	64, 633. 08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		75. 29	12, 056. 92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 6	109, 148. 11	126, 735. 64
负债合计		900, 350. 51	312, 972. 18
<b>净资产：</b>			
实收基金	6. 4. 7. 7	59, 564, 424. 91	278, 778, 788. 83
其他综合收益		-	-
未分配利润	6. 4. 7. 8	1, 314, 927. 88	3, 335, 006. 99
净资产合计		60, 879, 352. 79	282, 113, 795. 82
负债和净资产总计		61, 779, 703. 30	282, 426, 768. 00

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 59, 564, 424. 91 份。其中： 泰信添安增利九个月持有期债券 A 份额净值人民币 1. 0246 元，基金份额总额 12, 799, 097. 14 份； 泰信添安增利九个月持有期债券 C 份额净值人民币 1. 0214 元，基金份额总额 46, 765, 327. 77 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 6 月 7 日（基金 合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业收入</b>		1, 300, 551. 00	319, 315. 02
1. 利息收入		187, 023. 45	214, 795. 39
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 9	18, 105. 89	70, 199. 70

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		168,917.56	144,595.69
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		1,387,023.62	37,047.58
其中：股票投资收益	6.4.7.10	57,369.81	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,270,117.03	37,047.58
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	59,536.78	-
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	-273,496.07	67,472.05
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		594,087.00	144,061.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	265,194.01	69,947.80
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,779.13	10,492.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	177,883.41	47,457.02
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		6,292.26	424.49
8. 其他费用	6.4.7.19	104,938.19	15,740.33
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		706,464.00	175,253.20
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		706,464.00	175,253.20

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		706,464.00	175,253.20

### 6.3 净资产变动表

会计主体：泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2025年1月1日至2025年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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	278,778,788.83	-	3,335,006.99	282,113,795.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	278,778,788.83	-	3,335,006.99	282,113,795.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	219,214,363.92	-	-2,020,079.11	-221,234,443.03
(一)、综合收益总额	-	-	706,464.00	706,464.00
(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)	219,214,363.92	-	-2,726,543.11	-221,940,907.03
其中：1.基金申购款	54,602,058.33	-	861,913.08	55,463,971.41
2.基金赎回款	273,816,422.25	-	-3,588,456.19	-277,404,878.44
(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	-	-	-	-

益				
四、本期期末净资产	59,564,424.91	-	1,314,927.88	60,879,352.79
项目	上年度可比期间 2024年6月7日(基金合同生效日)至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	278,239,729.95	-	-	278,239,729.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	175,253.20	175,253.20
(一)、综合收益总额	-	-	175,253.20	175,253.20
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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	278,239,729.95	-	175,253.20	278,414,983.15

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>王弓箭</u>	<u>顾颖</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]95号《关于准予泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金注册的批复》核准，由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金根据认购/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278,239,729.95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(24)第00096号验资报告。《泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2024年6月7日正式生效。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市交易的股票(包括主板、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、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、债券回购、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、可转换债券(含可分离交易可转债)和可交换债券的投资比例合计不超过基金资产的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债新综合财富指数收益率×90%+沪深300指数收益率×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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项

税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。
- 2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。
- 3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
- 4) 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，对受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。
- 5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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 2025年6月30日
活期存款	394,460.50
等于：本金	394,370.06
加：应计利息	90.44
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		394,460.50

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 2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,625,797.99	-	7,735,299.20	109,501.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	49,173,761.96	264,322.01	49,553,494.01
	银行间市场	-	-	-
	合计	49,173,761.96	264,322.01	49,553,494.01
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	56,799,559.95	264,322.01	57,288,793.21	224,911.25

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,200,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025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	22,441.19
其中：交易所市场	22,441.19
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,706.92
合计	109,148.11

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

泰信添安增利九个月持有期债券 A

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	26,536,899.91	26,536,899.91
本期申购	11,988,875.49	11,988,875.49
本期赎回(以“-”号填列)	-25,726,678.26	-25,726,678.26
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	12,799,097.14	12,799,097.14

泰信添安增利九个月持有期债券 C

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	252,241,888.92	252,241,888.92
本期申购	42,613,182.84	42,613,182.84
本期赎回(以“-”号填列)	-248,089,743.99	-248,089,743.99
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	46,765,327.77	46,765,327.77

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

金额单位：人民币元

泰信添安增利九个月持有期债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	311,205.02	47,503.78	358,708.80
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	311,205.02	47,503.78	358,708.80
本期利润	129,894.91	14,877.28	144,772.19
本期基金份额交易产生的变动数	-133,949.73	-54,199.27	-188,149.00
其中：基金申购款	259,010.80	-54,367.27	204,643.53
基金赎回款	-392,960.53	168.00	-392,792.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	307,150.20	8,181.79	315,331.99

## 泰信添安增利九个月持有期债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,525,807.14	450,491.05	2,976,298.19
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,525,807.14	450,491.05	2,976,298.19
本期利润	850,065.16	-288,373.35	561,691.81
本期基金份额交易产生的变动数	-2,406,104.37	-132,289.74	-2,538,394.11
其中：基金申购款	753,832.96	-96,563.41	657,269.55
基金赎回款	-3,159,937.33	-35,726.33	-3,195,663.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	969,767.93	29,827.96	999,595.89

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	17,600.94
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	294.27
其他	210.68
合计	18,105.89

## 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收	57,369.81

入	
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	57,369.81

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	22,421,850.97
减：卖出股票成本总额	22,326,557.11
减：交易费用	37,924.05
买卖股票差价收入	57,369.81

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,222,247.62
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-952,130.59
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	1,270,117.03

##### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	444,813,935.80
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	438,722,369.36
减：应计利息总额	7,041,387.20
减：交易费用	2,309.83
买卖债券差价收入	-952,130.59

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	59,536.78
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	59,536.78

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	-273,496.07
股票投资	109,501.21
债券投资	-382,997.28
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	-273,496.07

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	18,199.55

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	8,631.27
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	104,938.19

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期本基金控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人
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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年6月7日（基金合 同生效日）至2024年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	265,194.01	69,947.80
其中：应付销售机构的客户维护 费	128,084.75	34,091.81
应支付基金管理人的净管理费	137,109.26	35,855.99

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%÷当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年6月7日（基金合 同生效日）至2024年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	39,779.13	10,492.18

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.06%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×0.06%÷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 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		
	泰信添安增利九个月 持有期债券 A	泰信添安增利九个月 持有期债券 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	546.55	546.55
交通银行	-	169,152.08	169,152.08
合计	-	169,698.63	169,698.63

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024年6月7日(基金合同生效日)至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信添安增利九个月持有期债券 A	泰信添安增利九个月持有期债券 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	-	-
交通银行	-	47,450.35	47,450.35
合计	-	47,450.35	47,450.35

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 类份额：支付的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$C \text{类日基金销售服务费} = \text{前一日} C \text{类基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

##### 泰信添安增利九个月持有期债券 A

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024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	4,915,437.56	8.25	-	-

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间	
		2024年6月7日(基金合同生效日)至 2024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
交通银行	394,460.50	17,600.94	901,153.37	70,199.70

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（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

会、董事会及下设审计、合规与风险控制委员会、督察长、监察稽核部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至附注 6.4.13.2.6 列示了于本报告期末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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	111,553,400.65
合计	-	111,553,400.65

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

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	1,424,616.22	108,210,436.70
AAA 以下	101,411.99	-
未评级	-	-

合计	1,526,028.21	108,210,436.70
----	--------------	----------------

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

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

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。此外，本基金可

通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2025 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

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 2025 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 60,739,605.05 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 2025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	394,460.50	-	-	-	394,460.50
结算备付金	246,438.92	-	-	-	246,438.92
存出保证金	20,386.25	-	-	-	20,386.25
交易性金融资产	34,806,306.88	8,010,801.10	6,736,386.03	7,735,299.20	57,288,793.21
买入返售金融资	3,200,000.00	-	-	-	3,200,000.00

产					
应收申购款	-	-	-	629,624.42	629,624.42
资产总计	38,667,592.55	8,010,801.10	6,736,386.03	8,364,923.62	61,779,703.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	508,666.21	508,666.21
应付管理人报酬	-	-	-	18,786.11	18,786.11
应付托管费	-	-	-	2,817.93	2,817.93
应付清算款	-	-	-	250,084.94	250,084.94
应付销售服务费	-	-	-	10,771.92	10,771.92
应交税费	-	-	-	75.29	75.29
其他负债	-	-	-	109,148.11	109,148.11
负债总计	-	-	-	900,350.51	900,350.51
利率敏感度缺口	38,667,592.55	8,010,801.10	6,736,386.03	7,464,573.11	60,879,352.79
上年度末 2024 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	179,579.54	-	-	-	179,579.54
交易性金融资产	230,108,609.63	10,299,342.47	21,830,819.96	-	262,238,772.06
买入返售金融资 产	20,008,416.40	-	-	-	20,008,416.40
资产总计	250,296,605.57	10,299,342.47	21,830,819.96	-	282,426,768.00
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	95,257.85	95,257.85
应付托管费	-	-	-	14,288.69	14,288.69
应付销售服务费	-	-	-	64,633.08	64,633.08
应交税费	-	-	-	12,056.92	12,056.92
其他负债	-	-	-	126,735.64	126,735.64
负债总计	-	-	-	312,972.18	312,972.18
利率敏感度缺口	250,296,605.57	10,299,342.47	21,830,819.96	-312,972.18	282,113,795.82

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)。		
	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）	
分析	本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）	
	1. 市场利率上升 25 个基点	-445,483.40	-1,514,460.49

	2. 市场利率下降 25 个基点	475,472.77	1,583,679.95
--	---------------------	------------	--------------

#### 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 2025年6月30日		上年度末 2024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	7,735,299.20	12.71	-	-
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	7,735,299.20	12.71	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	9,261,327.41	-
第二层次	48,027,465.80	262,238,772.06
第三层次	-	-
合计	57,288,793.21	262,238,772.06

##### 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 2025 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	7,735,299.20	12.52

	其中：股票	7,735,299.20	12.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,553,494.01	80.21
	其中：债券	49,553,494.01	80.21
	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	3,200,000.00	5.18
	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	640,899.42	1.04
8	其他各项资产	650,010.67	1.05
9	合计	61,779,703.30	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	-	-
B	采矿业	658,786.00	1.08
C	制造业	3,755,357.20	6.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	189,882.00	0.31
E	建筑业	91,743.00	0.15
F	批发和零售业	58,082.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	147,646.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	557,706.00	0.92
J	金融业	1,749,232.00	2.87
K	房地产业	149,904.00	0.25
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	100,633.00	0.17
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	31,200.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	245,128.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	7,735,299.20	12.71

### 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	300750	宁德时代	1,200	302,664.00	0.50
2	600519	贵州茅台	200	281,904.00	0.46
3	601318	中国平安	5,000	277,400.00	0.46
4	600036	招商银行	5,700	261,915.00	0.43
5	002850	科达利	1,900	215,023.00	0.35
6	300666	江丰电子	2,900	214,890.00	0.35
7	603893	瑞芯微	1,400	212,604.00	0.35
8	600900	长江电力	6,300	189,882.00	0.31
9	600460	士兰微	7,300	181,186.00	0.30
10	688256	寒武纪	300	180,450.00	0.30
11	002155	湖南黄金	9,880	176,358.00	0.29
12	601098	中南传媒	13,200	173,184.00	0.28
13	601899	紫金矿业	8,700	169,650.00	0.28
14	000333	美的集团	2,300	166,060.00	0.27
15	601166	兴业银行	7,100	165,714.00	0.27
16	600030	中信证券	5,800	160,196.00	0.26
17	600031	三一重工	8,600	154,370.00	0.25
18	600641	万业企业	10,800	149,904.00	0.25
19	603236	移远通信	1,700	145,860.00	0.24
20	688095	福昕软件	2,100	142,611.00	0.23
21	300604	长川科技	3,100	139,221.00	0.23
22	601288	农业银行	22,600	132,888.00	0.22
23	002594	比亚迪	400	132,764.00	0.22
24	002475	立讯精密	3,800	131,822.00	0.22
25	300059	东方财富	5,200	120,276.00	0.20
26	601816	京沪高铁	19,400	111,550.00	0.18
27	601728	中国电信	13,900	107,725.00	0.18
28	000858	五粮液	900	107,010.00	0.18
29	600060	海信视像	4,600	105,892.00	0.17
30	688114	华大智造	1,600	103,728.00	0.17
31	601857	中国石油	11,900	101,745.00	0.17
32	600276	恒瑞医药	1,900	98,610.00	0.16
33	601138	工业富联	4,600	98,348.00	0.16
34	601988	中国银行	17,300	97,226.00	0.16
35	601628	中国人寿	2,300	94,737.00	0.16
36	601088	中国神华	2,300	93,242.00	0.15

37	601668	中国建筑	15,900	91,743.00	0.15
38	601658	邮储银行	16,500	90,255.00	0.15
39	688049	炬芯科技	1,400	84,700.00	0.14
40	601211	国泰海通	4,300	82,388.00	0.14
41	600000	浦发银行	5,900	81,892.00	0.13
42	600186	莲花控股	13,600	81,600.00	0.13
43	600028	中国石化	14,400	81,216.00	0.13
44	000001	平安银行	6,600	79,662.00	0.13
45	002970	锐明技术	1,600	79,040.00	0.13
46	601900	南方传媒	4,600	71,944.00	0.12
47	000651	格力电器	1,500	67,380.00	0.11
48	603809	豪能股份	4,100	62,730.00	0.10
49	000338	潍柴动力	3,600	55,368.00	0.09
50	003013	地铁设计	3,600	51,948.00	0.09
51	300502	新易盛	400	50,808.00	0.08
52	603259	药明康德	700	48,685.00	0.08
53	002230	科大讯飞	1,000	47,880.00	0.08
54	300760	迈瑞医疗	200	44,950.00	0.07
55	688008	澜起科技	500	41,000.00	0.07
56	000977	浪潮信息	800	40,704.00	0.07
57	601998	中信银行	4,600	39,100.00	0.06
58	600489	中金黄金	2,500	36,575.00	0.06
59	601919	中远海控	2,400	36,096.00	0.06
60	002142	宁波银行	1,300	35,568.00	0.06
61	600760	中航沈飞	600	35,172.00	0.06
62	600482	中国动力	1,500	34,605.00	0.06
63	300274	阳光电源	500	33,885.00	0.06
64	600480	凌云股份	2,600	31,642.00	0.05
65	300054	鼎龙股份	1,100	31,548.00	0.05
66	688401	路维光电	900	31,230.00	0.05
67	300015	爱尔眼科	2,500	31,200.00	0.05
68	300001	特锐德	1,300	31,161.00	0.05
69	603288	海天味业	800	31,128.00	0.05
70	601456	国联民生	2,900	30,015.00	0.05
71	600729	重庆百货	1,000	29,830.00	0.05
72	603799	华友钴业	800	29,616.00	0.05
73	603612	索通发展	1,600	29,408.00	0.05
74	600150	中国船舶	900	29,286.00	0.05
75	600176	中国巨石	2,500	28,500.00	0.05
76	000963	华东医药	700	28,252.00	0.05
77	002001	新和成	1,300	27,651.00	0.05
78	000596	古井贡酒	200	26,630.00	0.04
79	688120	华海清科	16	2,699.20	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	601211	国泰海通	657,237.00	0.23
2	600519	贵州茅台	595,790.00	0.21
3	601098	中南传媒	472,844.00	0.17
4	300059	东方财富	399,461.00	0.14
5	601066	中信建投	384,516.00	0.14
6	300604	长川科技	355,044.00	0.13
7	300251	光线传媒	348,228.00	0.12
8	600900	长江电力	326,943.00	0.12
9	600109	国金证券	316,845.00	0.11
10	002797	第一创业	306,474.00	0.11
11	300750	宁德时代	299,531.00	0.11
12	601318	中国平安	273,308.00	0.10
13	688582	芯动联科	273,119.62	0.10
14	600036	招商银行	259,618.00	0.09
15	002850	科达利	259,368.00	0.09
16	002258	利尔化学	250,763.00	0.09
17	688088	虹软科技	250,548.78	0.09
18	601766	中国中车	249,375.00	0.09
19	601919	中远海控	247,818.00	0.09
20	603799	华友钴业	242,921.00	0.09

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交量）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	601211	国泰海通	590,662.00	0.21
2	601066	中信建投	385,001.00	0.14
3	300251	光线传媒	368,040.00	0.13
4	600109	国金证券	312,574.00	0.11
5	300059	东方财富	306,505.00	0.11
6	002797	第一创业	305,397.00	0.11
7	601098	中南传媒	298,555.00	0.11
8	600519	贵州茅台	283,338.00	0.10
9	688582	芯动联科	269,751.89	0.10
10	601766	中国中车	250,176.00	0.09
11	002258	利尔化学	247,617.00	0.09

12	300033	同花顺	231,891.00	0.08
13	688088	虹软科技	226,542.51	0.08
14	600490	鹏欣资源	223,115.00	0.08
15	002212	天融信	222,869.00	0.08
16	603799	华友钴业	222,547.00	0.08
17	600206	有研新材	219,345.00	0.08
18	300604	长川科技	216,714.00	0.08
19	300479	神思电子	216,238.00	0.08
20	688668	鼎通科技	213,097.36	0.08

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）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	29,952,355.10
卖出股票收入（成交）总额	22,421,850.97

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	48,027,465.80	78.89
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）	1,526,028.21	2.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,553,494.01	81.40

#### 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	019773	25 国债 08	140,000	14,043,261.92	23.07
2	019766	25 国债 01	121,000	12,153,329.51	19.96
3	019761	24 国债 24	80,000	8,010,801.10	13.16
4	019749	24 国债 15	45,000	4,557,175.89	7.49

5	019758	24 国债 21	21,000	2,118,843.62	3.48
---	--------	----------	--------	--------------	------

## 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

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规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选库之外的股票。

### 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	20,386.25
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	194.42
5	应收申购款	629,430.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	650,010.67

### 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	113050	南银转债	289,399.23	0.48
2	113065	齐鲁转债	259,078.08	0.43
3	113042	上银转债	255,388.77	0.42
4	113056	重银转债	251,905.21	0.41
5	113052	兴业转债	248,983.01	0.41
6	127018	本钢转债	119,861.92	0.20
7	127086	恒邦转债	101,411.99	0.17

### 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(%)
泰信添安增利九个月持有期债券 A	59	216,933.85	11,816,368.89	92.32	982,728.25	7.68
泰信添安增利九个月持有期债券 C	628	74,467.08	1,972,386.59	4.22	44,792,941.18	95.78
合计	687	86,702.22	13,788,755.48	23.15	45,775,669.43	76.85

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰信添安增利九个月持有期债券 A	497.71	0.0039
	泰信添安增利九个月持有期债券 C	9,033.57	0.0193

	合计	9,531.28	0.0160
--	----	----------	--------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰信添安增利九个月持有期债券 A	0
	泰信添安增利九个月持有期债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰信添安增利九个月持有期债券 A	0
	泰信添安增利九个月持有期债券 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	泰信添安增利九个月持有期债券 A	泰信添安增利九个月持有期债券 C
基金合同生效日 （2024 年 6 月 7 日）基金份额总额	26,536,887.97	251,702,841.98
本报告期内期初基金 份额总额	26,536,899.91	252,241,888.92
本报告期内基金总申 购份额	11,988,875.49	42,613,182.84
减：本报告期内基金 总赎回份额	25,726,678.26	248,089,743.99
本报告期内基金拆分 变动份额	-	-
本报告期内期末基金 份额总额	12,799,097.14	46,765,327.77

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、本报告期内基金管理人无重大人事变动。  
2、本报告期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，无涉基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
浙商证券	2	52,374,206. 07	100.00	23,353.69	100.00	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉、财务状况、处罚情况、内部控制等。公司通过规范选择券商租用专用交易席位的流程，对券商提供的研究服务情况进行定期考评，考评结果将成为交易席位租用与分配交易量的主要依据。

2、本报告期新增交易单元：无；退租交易单元：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券交易比例	成交金额	占当期债券 回购交易比例	成交金额	占当期权 证交易比例

		券 成交总额 的比例(%)		回购成交总 额的比例 (%)		证 成交总额 的比例 (%)
浙商证券	275,155,39 8.77	100.00	23,900,000.0 0	100.00	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2025年1月15日
2	泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金2024年第四季度报告	规定报刊及规定网站	2025年1月21日
3	泰信基金管理有限公司关于旗下部分基金参加德邦证券股份有限公司申购及定期定额申购业务费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2025年2月17日
4	泰信基金管理有限公司关于泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金在交通银行股份有限公司开通定投、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2025年3月6日
5	泰信基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券股份有限公司和海通证券股份有限公司申购定投业务费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2025年3月24日
6	泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金2024年年度报告	规定报刊及规定网站	2025年3月28日
7	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（2024年度）	规定报刊及规定网站	2025年3月31日
8	泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金2025年第一季度报告	规定报刊及规定网站	2025年4月21日
9	泰信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华西证券股份有限公司为销售机构并开通定投、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2025年4月25日
10	关于泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	规定报刊及规定网站	2025年5月7日

11	泰信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2025 年 5 月 8 日
12	泰信基金管理有限公司关于关闭网上直销交易平台、微信平台相关业务服务的公告	规定报刊及规定网站	2025 年 5 月 14 日
13	泰信基金管理有限公司关于泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金新增国融证券股份有限公司为销售机构并开通定投和转换业务的公告	规定报刊及规定网站	2025 年 5 月 15 日
14	关于泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	规定报刊及规定网站	2025 年 5 月 21 日
15	关于泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	规定报刊及规定网站	2025 年 5 月 28 日
16	泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金更新招募说明书、产品资料概要更新（2025 年 1 号）	规定报刊及规定网站	2025 年 6 月 7 日
17	泰信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并开通定投和转换业务及参加其费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2025 年 6 月 26 日
18	泰信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增贵州省贵文文化基金销售有限公司为销售机构并开通定投、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2025 年 6 月 26 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金设立的文件

- 2、《泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

## 12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

## 12.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站([www.ftfund.com](http://www.ftfund.com))查阅上述相关文件，或拨打客户服务电话(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

2025年8月28日