

泰信双息双利债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
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	14
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 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	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	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	48

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	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.11 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	52
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信双息双利债券型证券投资基金	
基金简称	泰信双息双利债券	
基金主代码	290003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 10 月 31 日	
基金管理人	泰信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,002,721,643.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰信双息双利债券 A	泰信双息双利债券 C
下属分级基金的交易代码	024181	290003
报告期末下属分级基金的份额总额	57,926,375.06 份	944,795,268.59 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是在获取债券稳定收益的基础上，通过股票一级市场申购及适当的二级市场投资等手段谋求高于比较基准的收益。
投资策略	在本基金投资管理计划中，投资策略由自上而下的资产配置计划和自下而上的选股（或债券）计划组成，本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利率走势、企业盈利和信用状况等等的动态分析，在限定投资范围内，决定债券类资产、股票类等工具的配置比例。并跟踪影响资产策略配置的各种因素的变化，定期对资产策略配置比例进行调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为上证国债指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的低风险品种，预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘小舫	郭明
	联系电话	021-20899003	(010) 66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李高峰	廖林

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)	
	泰信双息双利债券 A	泰信双息双利债券 C
本期已实现收益	2, 221, 289. 30	10, 599, 735. 40
本期利润	2, 771, 702. 20	26, 030, 779. 57
加权平均基金份额 本期利润	0. 0131	0. 0370
本期加权平均净 值利润率	1. 19%	3. 22%
本期基金份额净 值增长率	3. 37%	3. 37%
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	4, 072, 635. 96	111, 808, 890. 67
期末可供分配基 金份额利润	0. 0703	0. 1183
期末基金资产净 值	65, 349, 895. 62	1, 112, 184, 901. 03

期末基金份额净值	1.1282	1.1772
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	7.54%	116.49%

注：1、本基金合同于 2007 年 10 月 31 日正式生效。经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，自 2025 年 6 月 12 日起泰信双息双利债券型证券投资基金增加 A 类基金份额。

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

泰信双息双利债券 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
过去三个月	4.37%	0.27%	0.99%	0.04%	3.38%	0.23%
过去六个月	3.37%	0.25%	1.64%	0.04%	1.73%	0.21%
过去一年	6.83%	0.21%	1.21%	0.05%	5.62%	0.16%
自基金合同生效起至今	7.54%	0.21%	1.50%	0.05%	6.04%	0.16%

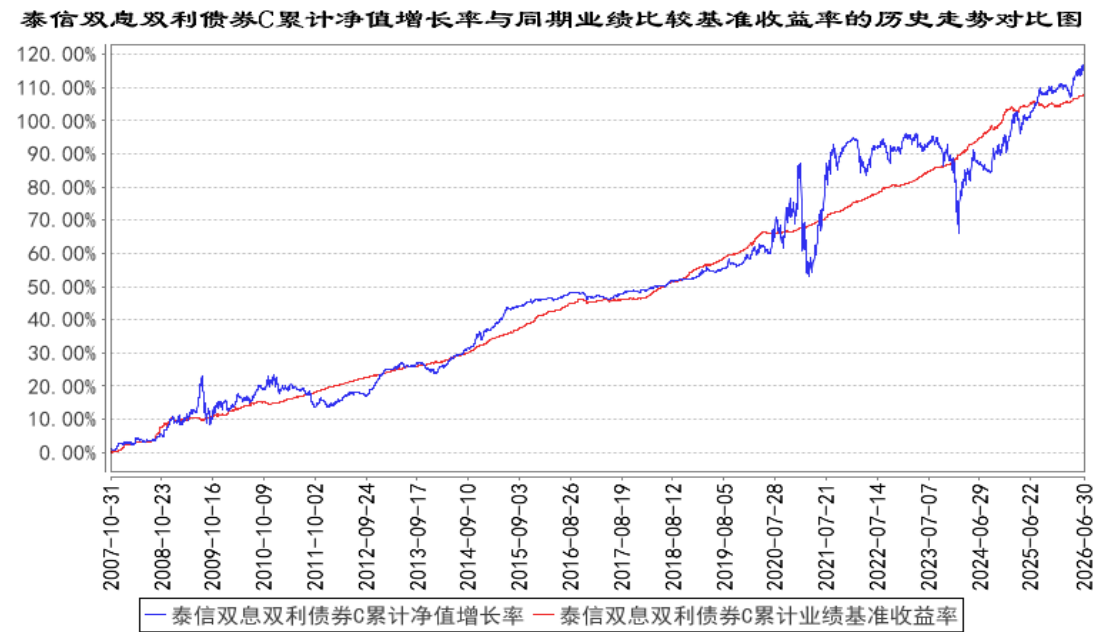
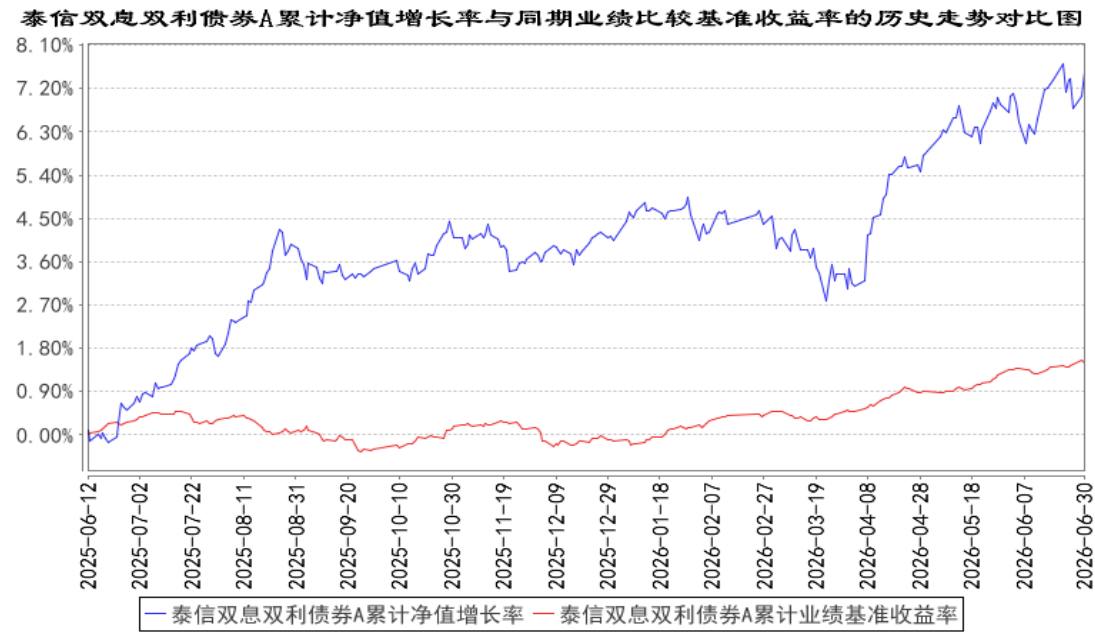
泰信双息双利债券 C

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
过去三个月	4.36%	0.27%	0.99%	0.04%	3.37%	0.23%
过去六个月	3.37%	0.25%	1.64%	0.04%	1.73%	0.21%
过去一年	6.83%	0.21%	1.21%	0.05%	5.62%	0.16%
过去三年	12.40%	0.41%	12.60%	0.06%	-0.20%	0.35%
过去五年	23.73%	0.41%	22.20%	0.05%	1.53%	0.36%

过去七年	39.71%	0.50%	31.75%	0.05%	7.96%	0.45%
过去十年	47.36%	0.42%	44.82%	0.04%	2.54%	0.38%
自基金合同生效起 至今	116.49%	0.36%	107.72%	0.06%	8.77%	0.30%

注：本基金业绩比较基准为：上证国债指数。

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



注：1、自 2025 年 6 月 12 日起，本基金增加 A 类基金份额。

2、经泰信中短期债券投资基金 2007 年 9 月 27 日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过，

第 8 页 共 56 页

并经中国证监会 2007 年 10 月 26 日证监基金字[2007] 293 号文核准，泰信中短期债券投资基金变更为泰信双息双利债券型证券投资基金，自 2007 年 10 月 31 日起，由《泰信中短期债券投资基金基金合同》修订而成的《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》正式生效。业绩比较基准由“2 年期银行定期存款利率（税后）”变更为“上证国债指数”。

3、本基金投资组合的规定为：主要投资于债券类金融工具。债券类金融工具包括国债、央行票据、金融债、信用等级为投资级的企业债（包括可转债）、可分离性债券、短期融资券、资产支持证券等法律法规或中国证监会允许投资的固定收益品种。上述资产投资比例不低于基金资产的 80%。其中，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 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		
张安格	泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理、泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理、泰信汇鑫三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理、泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金经理、泰信添瑞债券型证券投资基金基金经理	2024 年 7 月 27 日	—	11 年	张安格女士，研究生学历。曾任职于申万宏源证券有限公司资产管理事业部，从事固定收益类产品的设计、交易、研究及投资。2020 年 12 月加入泰信基金管理有限公司拟任基金经理。2021 年 2 月任泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至 2023 年 11 月任泰信汇享利率债券型证券投资基金基金经理，2022 年 3 月任泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 3 月至 2025 年 10 月任泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 3 月至 2025 年 11 月任泰信汇盈债券型证券投资基金基金经理，2022 年 10 月任泰信汇鑫三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2024 年 7 月任泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理，2024 年 7 月任泰信添安增利九个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2026 年 4 月任泰信添瑞债券型证券投资基金基金经理。
张海涛	泰信中证 200 指数证券投资	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

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

	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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18号），公司制定了《泰信基金管理有限公司公平交易管理办法》以及《泰信基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

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

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

上半年债券市场收益率震荡下行，波动率呈逐步收敛的状态。中短端债券受益于资金面宽松的利好，在上涨过程中回撤较小，整体的持有体验较好，其中中短久期信用债更是享受了信用利差压缩的超额收益。而超长期利率债则更考验投资者的交易能力，在前四个月波动较大，近期波动率则显著降低。

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

股票投资上，本基金依托量化多因子模型开展投资决策，全市场优选个股，同时适度保持分散和行业均衡。转债投资方面，本基金重点关注高价高弹性品种的机会，并灵活调整仓位；纯债投资则以中短久期信用债为底仓，并辅以利率债波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信双息双利债券 A 基金份额净值为 1.1282 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.37%;截止本报告期末泰信双息双利债券 C 基金份额净值为 1.1772 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.37%;同期业绩比较基准收益率为 1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

债券市场则可能会在一段时间内维持窄幅震荡的格局，主要原因在于经济基本面和资金利率在短期内会相对平稳，出现超预期变化的可能性较低。债券市场的波动，更多可能是受债券供需平衡的影响，但此类影响相对可控。一方面，债市供给较大时，央行更倾向于维持较为宽松的资

金面以支持债券市场的稳定运行；另一方面，需求端在风险偏好不发生显著改变的情况下，具有较强的自我调节能力，可在一定程度上平抑市场的波动。从内部结构来看，未来一段时间债市的超额收益可能会来自超长利率债，期限利差是当前债市为数不多具有博弈空间的地方。信用债方面，需逐步提高对信用风险的识别，防范少数主体的信用利差扩张的风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 30%，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按除权日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；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、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

4、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

5、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；

6、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

7、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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——泰信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：泰信双息双利债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,720,457.23	1,369,726.79
结算备付金		1,639,958.22	1,697,230.18
存出保证金		101,495.45	92,798.70
交易性金融资产	6.4.7.2	1,143,062,398.90	1,523,313,921.71
其中：股票投资		188,112,983.10	235,274,809.61
基金投资		-	-
债券投资		954,949,415.80	1,288,039,112.10
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	-	25,997,193.42
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		38,992,932.47	26,035,274.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,194,517,242.27	1,578,506,144.94
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		13,026,552.01	12,742,787.38
应付赎回款		2,582,249.99	13,628,993.81
应付管理人报酬		562,991.88	942,197.22
应付托管费		160,854.84	269,199.21
应付销售服务费		7,481.79	10,162.89
应付投资顾问费		-	-
应交税费		308,173.83	312,500.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	334,141.28	488,578.05
负债合计		16,982,445.62	28,394,419.35
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,002,721,643.65	1,378,422,076.90
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	174,813,153.00	171,689,648.69
净资产合计		1,177,534,796.65	1,550,111,725.59
负债和净资产总计		1,194,517,242.27	1,578,506,144.94

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,002,721,643.65 份。其中：泰信双息双利债券 A 份额净值人民币 1.1282 元，基金份额总额 57,926,375.06 份；泰信双息双利债券 C 份额净

值人民币 1.1772 元，基金份额总额 944,795,268.59 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信双息双利债券型证券投资基金

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	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		33,787,503.55	1,589,574.68
1. 利息收入		38,254.01	4,923.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	24,659.90	1,888.54
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		13,594.11	3,034.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		17,722,503.90	1,118,406.96
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,201,779.37	487,309.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	14,619,862.74	554,180.79
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	1,900,861.79	76,916.88
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	15,981,457.07	459,007.80
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	45,288.57	7,236.64
减：二、营业总支出		4,985,021.78	129,250.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,641,105.11	98,705.14
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,040,315.71	28,201.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	40,226.07	1,410.13

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		111,705.88	-
其中：卖出回购金融资产支出		111,705.88	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		24,914.53	55.45
8. 其他费用	6.4.7.19	126,754.48	878.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		28,802,481.77	1,460,323.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		28,802,481.77	1,460,323.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		28,802,481.77	1,460,323.98

6.3 净资产变动表

会计主体：泰信双息双利债券型证券投资基金

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	1,378,422,076.90	-	171,689,648.69	1,550,111,725.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,378,422,076.90	-	171,689,648.69	1,550,111,725.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-375,700,433.25	-	3,123,504.31	-372,576,928.94
（一）、综合收益总额	-	-	28,802,481.77	28,802,481.77
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	-375,700,433.25	-	-25,678,977.46	-401,379,410.71

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	1,341,546,800.30	-	213,233,198.63	1,554,779,998.93
2. 基金赎回款	-1,717,247,233.55	-	-238,912,176.09	-1,956,159,409.64
(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	1,002,721,643.65	-	174,813,153.00	1,177,534,796.65
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	16,112,347.40	-	897,843.31	17,010,190.71
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	16,112,347.40	-	897,843.31	17,010,190.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	117,210,157.79	-	12,690,002.16	129,900,159.95
(一)、综合收益总额	-	-	1,460,323.98	1,460,323.98
(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)	117,210,157.79	-	11,229,678.18	128,439,835.97
其中：1. 基金申购款	142,175,257.50	-	13,444,013.75	155,619,271.25

2. 基金赎回款	-24,965,099.71	-	-2,214,335.57	-27,179,435.28
(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	133,322,505.19	-	13,587,845.47	146,910,350.66

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

基金管理人负责人

段晓旭

主管会计工作负责人

顾颖

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信双息双利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据原泰信中短期债券投资基金(以下简称“原泰信中短债基金”)基金份额持有人大会 2007 年 9 月 27 日审议通过的《关于泰信中短期债券投资基金转型为泰信双息双利债券型证券投资基金有关事项的议案》及经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第 293 号《关于核准泰信中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》批准，由原泰信中短债基金转型而来。

根据《泰信中短期债券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致并经中国证监会核准，基金管理人泰信基金管理有限公司将《泰信中短期债券投资基金基金合同》修订为《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》。

《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》自 2007 年 10 月 31 日起生效，原《泰信中短期债券投资基金基金合同》同日失效。

根据本基金的基金管理人 2025 年 6 月 12 日发布的《关于泰信双息双利债券型证券投资基金增加 A 类基金份额并修改基金法律文件的公告》，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，自 2025 年 6 月 12 日起，对本基金增加 A 类基金份额(基金代码：024181)，并对《泰信双

息双利债券型证券投资基金基金合同》、《泰信双息双利债券型证券投资基金托管协议》等法律文件进行修订，同时对基金管理人、基金托管人的基本信息进行了更新。本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。A 类基金份额在投资者申购时收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费。C 类基金份额在投资者申购时不收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费。自 2025 年 6 月 12 日本基金的基金份额分类实施后，本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金 C 类基金份额(基金代码：290003)。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。原有 C 类基金份额的申购赎回业务规则以及费率结构均保持不变，具体规定详见本基金管理人发布的相关法律文件和公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围变更为主要投资于债券类金融工具。债券类金融工具包括国债、央行票据、金融债、信用等级为投资级的企业债(包括可转债)、可分离性债券、短期融资券、资产支持证券等法律法规或中国证监会允许投资的固定收益品种。上述资产投资比例不低于基金资产的 80%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金可以参与一级市场新股申购、股票、权证的投资，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。非债券类金融工具的投资比例不超过基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为上证国债指数。

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》及深圳证券交易所发布的《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	10,720,457.23
等于：本金	10,720,126.58
加：应计利息	330.65
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	10,720,457.23
----	---------------

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		178,753,871.85	-	188,112,983.10	9,359,111.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	224,591,038.23	1,185,609.20	235,351,829.20	9,575,181.77
	银行间市场	709,231,601.90	8,611,386.60	719,597,586.60	1,754,598.10
	合计	933,822,640.13	9,796,995.80	954,949,415.80	11,329,779.87
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,112,576,511.98	9,796,995.80	1,143,062,398.90	20,688,891.12

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	457.99
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	232,439.04
其中：交易所市场	225,662.04
银行间市场	6,777.00
应付利息	-
预提费用	101,244.25
合计	334,141.28

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

泰信双息双利债券 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	413,918,963.17	413,918,963.17
本期申购	35,806,879.88	35,806,879.88
本期赎回（以“-”号填列）	-391,799,467.99	-391,799,467.99
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	57,926,375.06	57,926,375.06

泰信双息双利债券 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	964,503,113.73	964,503,113.73
本期申购	1,305,739,920.42	1,305,739,920.42
本期赎回（以“-”号填列）	-1,325,447,765.56	-1,325,447,765.56
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	944,795,268.59	944,795,268.59

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

泰信双息双利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,110,800.16	15,708,237.77	37,819,037.93
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	22,110,800.16	15,708,237.77	37,819,037.93
本期利润	2,221,289.30	550,412.90	2,771,702.20
本期基金份额交易产生的变动数	-20,259,453.50	-12,907,766.07	-33,167,219.57
其中：基金申购款	2,462,223.56	1,719,983.45	4,182,207.01
基金赎回款	-22,721,677.06	-14,627,749.52	-37,349,426.58
本期已分配利润	-	-	-

本期末	4,072,635.96	3,350,884.60	7,423,520.56
泰信双息双利债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	97,150,876.34	36,719,734.42	133,870,610.76
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	97,150,876.34	36,719,734.42	133,870,610.76
本期利润	10,599,735.40	15,431,044.17	26,030,779.57
本期基金份额交易产生的变动数	4,058,278.93	3,429,963.18	7,488,242.11
其中：基金申购款	148,017,052.47	61,033,939.15	209,050,991.62
基金赎回款	-143,958,773.54	-57,603,975.97	-201,562,749.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	111,808,890.67	55,580,741.77	167,389,632.44

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	18,328.09
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	5,039.90
其他	1,291.91
合计	24,659.90

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	1,201,779.37
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	1,201,779.37

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	474,139,878.21
减：卖出股票成本总额	472,244,599.08
减：交易费用	693,499.76
买卖股票差价收入	1,201,779.37

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	10,654,757.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,965,105.60
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	14,619,862.74

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	1,353,944,124.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,332,189,151.49
减：应计利息总额	17,754,701.08
减：交易费用	35,166.25
买卖债券差价收入	3,965,105.60

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	1,900,861.79
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	1,900,861.79

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	15,981,457.07
股票投资	4,316,492.54
债券投资	11,664,964.53
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	15,981,457.07

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	44,664.66
基金转换费收入	623.91
合计	45,288.57

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	32,736.88
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	15,910.23
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	126,754.48

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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	3,641,105.11	98,705.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,413,992.98	44,863.45
应支付基金管理人的净管理费	2,227,112.13	53,841.69

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×0.70%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% \div \text{当年天数}。$$

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	1,040,315.71	28,201.46

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

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

	泰信双息双利债券 A	泰信双息双利债券 C	合计
泰信基金管理有限公司	—	146.01	146.01
中国工商银行	—	378.48	378.48
合计	—	524.49	524.49
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	泰信双息双利债券 A	泰信双息双利债券 C	合计
泰信基金管理有限公司	—	20.42	20.42
中国工商银行	—	357.77	357.77
合计	—	378.19	378.19

注：1、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率为 0.30%。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×0.30%÷当年天数。

2、根据《泰信基金管理有限公司关于开展泰信双息双利债券型证券投资基金销售服务费优惠活动的公告》，自 2021 年 12 月 31 日起，本基金实施销售服务费优惠由 0.30%降低至 0.01%，优惠截止时间将另行公告。C 类份额销售服务费的计算方法如下：

C 类日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.01%÷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

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		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
中国工商银行	10,720,457.23	18,328.09	299,040.09	1,784.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

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，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中国工商银行，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	104,110,740.81	299,920,929.32
合计	104,110,740.81	299,920,929.32

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	391,515,637.80	258,929,865.54
AAA 以下	107,090,026.46	182,860,964.28
未评级	81,997,139.72	—
合计	580,602,803.98	441,790,829.82

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

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2026 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

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 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 1,180,396,212.16 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	10,720,457.23	-	-	-	10,720,457.23
结算备付金	1,639,958.22	-	-	-	1,639,958.22
存出保证金	101,495.45	-	-	-	101,495.45
交易性金融资产	593,253,560.51	258,350,094.04	103,345,761.25	188,112,983.10	1,143,062,398.90
应收申购款	-	-	-	38,992,932.47	38,992,932.47
资产总计	605,715,471.41	258,350,094.04	103,345,761.25	227,105,915.57	1,194,517,242.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,582,249.99	2,582,249.99
应付管理人报酬	-	-	-	562,991.88	562,991.88
应付托管费	-	-	-	160,854.84	160,854.84
应付清算款	-	-	-	13,026,552.01	13,026,552.01
应付销售服务费	-	-	-	7,481.79	7,481.79
应交税费	-	-	-	308,173.83	308,173.83
其他负债	-	-	-	334,141.28	334,141.28
负债总计	-	-	-	16,982,445.62	16,982,445.62
利率敏感度缺口	605,715,471.41	258,350,094.04	103,345,761.25	210,123,469.95	1,177,534,796.65
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	1,369,726.79	-	-	-	1,369,726.79
结算备付金	1,697,230.18	-	-	-	1,697,230.18
存出保证金	92,798.70	-	-	-	92,798.70
交易性金融资产	893,658,673.11	334,209,913.99	60,170,525.00	235,274,809.61	1,523,313,921.71
买入返售金融资产	25,997,193.42	-	-	-	25,997,193.42
应收申购款	-	-	-	26,035,274.14	26,035,274.14
资产总计	922,815,622.20	334,209,913.99	60,170,525.00	261,310,083.75	1,578,506,144.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,628,993.81	13,628,993.81
应付管理人报酬	-	-	-	942,197.22	942,197.22
应付托管费	-	-	-	269,199.21	269,199.21
应付清算款	-	-	-	12,742,787.38	12,742,787.38
应付销售服	-	-	-	10,162.89	10,162.89

务费					
应交税费	-	-	-	312,500.79	312,500.79
其他负债	-	-	-	488,578.05	488,578.05
负债总计	-	-	-	28,394,419.35	28,394,419.35
利率敏感度缺口	922,815,622.20	334,209,913.99	60,170,525.00	232,915,664.40	1,550,111,725.59

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（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	-13,285,681.22	-5,279,761.31
	2. 市场利率下降 25 个基点	14,178,025.67	5,365,538.24

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	188,112,983.10	15.98	235,274,809.61	15.18
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	188,112,983.10	15.98	235,274,809.61	15.18

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 15.98%(2025 年 12 月 31 日：15.18%)，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14 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	243,987,867.09	264,927,212.58
第二层次	899,074,531.81	1,258,386,709.13
第三层次	－	－
合计	1,143,062,398.90	1,523,313,921.71

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	188,112,983.10	15.75
	其中：股票	188,112,983.10	15.75
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	954,949,415.80	79.94
	其中：债券	954,949,415.80	79.94
	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	12,360,415.45	1.03
8	其他各项资产	39,094,427.92	3.27
9	合计	1,194,517,242.27	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	1,632,877.00	0.14
B	采矿业	9,412,378.29	0.80

C	制造业	123,905,935.81	10.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,548,601.00	0.39
E	建筑业	1,770,718.00	0.15
F	批发和零售业	328,485.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	4,493,677.56	0.38
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,585,317.50	0.64
J	金融业	31,097,323.00	2.64
K	房地产业	858,083.00	0.07
L	租赁和商务服务业	1,016.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	2,477,749.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	747.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	74.34	0.00
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	188,112,983.10	15.98

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	300308	中际旭创	7,600	9,652,000.00	0.82
2	300750	宁德时代	17,500	6,877,675.00	0.58
3	300502	新易盛	9,900	6,009,300.00	0.51
4	600519	贵州茅台	4,000	4,741,960.00	0.40
5	603986	兆易创新	4,800	3,912,000.00	0.33
6	688256	寒武纪	2,410	3,845,275.50	0.33
7	600036	招商银行	91,100	3,234,050.00	0.27
8	601899	紫金矿业	124,300	3,124,902.00	0.27
9	601318	中国平安	61,900	2,955,106.00	0.25
10	000333	美的集团	38,200	2,885,246.00	0.25
11	688008	澜起科技	9,200	2,851,080.00	0.24
12	002384	东山精密	10,400	2,728,440.00	0.23
13	603259	药明康德	19,900	2,477,749.00	0.21
14	688041	海光信息	6,144	2,275,123.20	0.19
15	002371	北方华创	2,470	2,184,863.20	0.19

16	600030	中信证券	75,300	2,163,369.00	0.18
17	002475	立讯精密	30,000	2,112,000.00	0.18
18	600900	长江电力	74,800	1,979,956.00	0.17
19	300408	三环集团	11,800	1,969,420.00	0.17
20	688012	中微公司	4,200	1,967,700.00	0.17
21	600276	恒瑞医药	37,544	1,953,789.76	0.17
22	300059	东方财富	95,200	1,940,176.00	0.16
23	600183	生益科技	10,900	1,890,060.00	0.16
24	002463	沪电股份	11,700	1,787,760.00	0.15
25	688981	中芯国际	10,625	1,687,462.50	0.14
26	601166	兴业银行	101,200	1,675,872.00	0.14
27	601138	工业富联	22,000	1,587,300.00	0.13
28	600176	中国巨石	21,700	1,581,496.00	0.13
29	000725	京东方 A	179,700	1,559,796.00	0.13
30	601288	农业银行	255,600	1,551,492.00	0.13
31	000651	格力电器	40,900	1,533,750.00	0.13
32	603019	中科曙光	14,300	1,533,389.00	0.13
33	600584	长电科技	14,300	1,480,765.00	0.13
34	600522	中天科技	24,100	1,462,388.00	0.12
35	600919	江苏银行	134,800	1,453,144.00	0.12
36	600150	中国船舶	40,213	1,358,797.27	0.12
37	600887	伊利股份	56,100	1,344,156.00	0.11
38	000338	潍柴动力	47,620	1,297,645.00	0.11
39	603993	洛阳钼业	73,000	1,281,150.00	0.11
40	300274	阳光电源	7,800	1,240,356.00	0.11
41	002594	比亚迪	15,200	1,211,440.00	0.10
42	600309	万华化学	17,100	1,169,811.00	0.10
43	300476	胜宏科技	3,200	1,108,576.00	0.09
44	601211	国泰海通	60,500	1,101,100.00	0.09
45	601088	中国神华	27,900	1,089,216.00	0.09
46	600089	特变电工	47,500	1,068,750.00	0.09
47	300394	天孚通信	3,500	1,059,380.00	0.09
48	601857	中国石油	121,100	1,051,148.00	0.09
49	002142	宁波银行	35,000	1,039,150.00	0.09
50	601328	交通银行	160,100	1,029,443.00	0.09
51	000001	平安银行	98,600	990,930.00	0.08
52	002714	牧原股份	27,900	976,221.00	0.08
53	002353	杰瑞股份	6,300	960,750.00	0.08
54	601939	建设银行	96,500	929,295.00	0.08
55	000988	华工科技	4,900	904,589.00	0.08
56	000977	浪潮信息	12,900	903,000.00	0.08
57	300124	汇川技术	13,600	902,088.00	0.08
58	300760	迈瑞医疗	6,600	896,478.00	0.08

59	600460	士兰微	16,100	880,026.00	0.07
60	002938	鹏鼎控股	8,300	874,654.00	0.07
61	002460	赣锋锂业	12,900	843,660.00	0.07
62	002600	领益智造	48,300	837,522.00	0.07
63	300033	同花顺	3,400	819,400.00	0.07
64	002352	顺丰控股	26,000	812,760.00	0.07
65	603799	华友钴业	16,700	805,942.00	0.07
66	002179	中航光电	17,400	803,880.00	0.07
67	600926	杭州银行	55,600	803,420.00	0.07
68	000938	紫光股份	27,300	787,878.00	0.07
69	601985	中国核电	86,500	781,095.00	0.07
70	601100	恒立液压	7,200	774,432.00	0.07
71	002602	世纪华通	54,400	767,040.00	0.07
72	601009	南京银行	77,100	762,519.00	0.06
73	000568	泸州老窖	9,800	759,696.00	0.06
74	000858	五粮液	9,700	717,800.00	0.06
75	600809	山西汾酒	6,500	710,905.00	0.06
76	688506	百利天恒	2,400	705,672.00	0.06
77	301308	江波龙	1,000	703,800.00	0.06
78	601127	赛力斯	11,400	698,250.00	0.06
79	601336	新华保险	11,700	698,022.00	0.06
80	603893	瑞芯微	3,700	696,932.00	0.06
81	600958	东方证券	73,200	691,008.00	0.06
82	688361	中科飞测	1,600	688,000.00	0.06
83	600893	航发动力	17,900	686,286.00	0.06
84	601006	大秦铁路	147,900	681,819.00	0.06
85	601995	中金公司	18,500	668,775.00	0.06
86	600989	宝丰能源	32,700	664,791.00	0.06
87	300498	温氏股份	53,300	656,656.00	0.06
88	002558	巨人网络	23,500	647,660.00	0.06
89	600489	中金黄金	35,800	646,190.00	0.05
90	601838	成都银行	36,300	642,510.00	0.05
91	600875	东方电气	22,000	632,940.00	0.05
92	601816	京沪高铁	136,400	617,892.00	0.05
93	601012	隆基绿能	46,900	615,328.00	0.05
94	600010	宝钢股份	275,100	613,473.00	0.05
95	688409	富创精密	2,000	612,500.00	0.05
96	600547	山东黄金	26,300	607,267.00	0.05
97	600362	江西铜业	14,000	606,200.00	0.05
98	601825	沪农商行	80,500	602,945.00	0.05
99	600346	恒力石化	33,800	598,598.00	0.05
100	600115	中国东航	156,200	595,122.00	0.05
101	601998	中信银行	85,500	592,515.00	0.05

102	600104	上汽集团	58,800	573,888.00	0.05
103	601111	中国国航	94,100	569,305.00	0.05
104	300803	指南针	6,000	550,020.00	0.05
105	301165	锐捷网络	6,700	539,015.00	0.05
106	003816	中国广核	137,500	537,625.00	0.05
107	002028	思源电气	3,100	536,300.00	0.05
108	600011	华能国际	70,600	535,854.00	0.05
109	601668	中国建筑	123,400	535,556.00	0.05
110	688110	东芯股份	2,600	529,620.00	0.04
111	688521	芯原股份	1,400	519,596.00	0.04
112	603929	亚翔集成	1,900	516,838.00	0.04
113	603083	剑桥科技	2,000	509,740.00	0.04
114	002415	海康威视	14,700	502,740.00	0.04
115	601319	中国人保	73,000	493,480.00	0.04
116	600000	浦发银行	56,500	486,465.00	0.04
117	600111	北方稀土	10,100	485,305.00	0.04
118	600029	南方航空	90,900	470,862.00	0.04
119	605499	东鹏饮料	3,800	469,034.00	0.04
120	688141	杰华特	3,000	460,500.00	0.04
121	002916	深南电路	1,000	457,900.00	0.04
122	000783	长江证券	46,600	454,350.00	0.04
123	300666	江丰电子	1,200	442,320.00	0.04
124	601869	长飞光纤	800	436,720.00	0.04
125	600641	先导基电	10,800	430,488.00	0.04
126	001979	招商蛇口	66,500	427,595.00	0.04
127	000063	中兴通讯	11,500	416,185.00	0.04
128	600023	浙能电力	78,800	414,488.00	0.04
129	000895	双汇发展	18,500	414,400.00	0.04
130	600018	上港集团	87,700	413,944.00	0.04
131	002202	金风科技	17,300	413,470.00	0.04
132	300285	国瓷材料	4,000	412,720.00	0.04
133	300857	协创数据	1,200	407,880.00	0.03
134	605289	罗曼股份	2,800	406,000.00	0.03
135	000617	中油资本	61,100	402,649.00	0.03
136	601456	国联民生	45,500	402,220.00	0.03
137	000661	长春高新	6,000	399,600.00	0.03
138	002484	江海股份	3,800	399,000.00	0.03
139	000066	中国长城	20,900	398,145.00	0.03
140	600105	永鼎股份	5,900	398,132.00	0.03
141	002850	科达利	2,100	397,530.00	0.03
142	688578	艾力斯	3,600	393,120.00	0.03
143	000636	风华高科	5,400	390,096.00	0.03
144	000100	TCL 科技	65,700	382,374.00	0.03

145	002050	三花智控	8,700	381,321.00	0.03
146	300433	蓝思科技	7,100	380,986.00	0.03
147	603688	石英股份	4,600	380,006.00	0.03
148	600601	方正科技	27,400	379,216.00	0.03
149	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.03
150	688025	杰普特	800	376,000.00	0.03
151	601225	陕西煤业	18,400	374,440.00	0.03
152	600999	招商证券	17,700	373,470.00	0.03
153	603806	福斯特	22,000	369,380.00	0.03
154	601555	东吴证券	46,300	366,696.00	0.03
155	600487	亨通光电	3,300	360,822.00	0.03
156	688167	炬光科技	1,000	354,210.00	0.03
157	002851	麦格米特	2,100	351,078.00	0.03
158	601727	上海电气	50,000	350,000.00	0.03
159	003022	联泓新科	13,500	349,650.00	0.03
160	601208	东材科技	4,900	346,871.00	0.03
161	301217	铜冠铜箔	2,100	346,647.00	0.03
162	600498	烽火通信	4,700	345,920.00	0.03
163	300870	欧陆通	1,000	345,690.00	0.03
164	603699	纽威股份	6,800	342,040.00	0.03
165	603308	应流股份	5,600	338,240.00	0.03
166	000792	盐湖股份	11,000	332,090.00	0.03
167	600031	三一重工	19,200	331,776.00	0.03
168	601061	中信金属	30,500	328,485.00	0.03
169	300726	宏达电子	3,700	312,909.00	0.03
170	601868	中国能建	116,700	311,589.00	0.03
171	601168	西部矿业	11,200	303,968.00	0.03
172	603663	三祥新材	3,100	298,530.00	0.03
173	601699	潞安环能	20,900	298,452.00	0.03
174	601991	大唐发电	42,100	298,068.00	0.03
175	600988	赤峰黄金	11,300	297,416.00	0.03
176	600418	江淮汽车	11,500	297,045.00	0.03
177	601689	拓普集团	5,200	293,384.00	0.02
178	300014	亿纬锂能	4,500	292,635.00	0.02
179	601601	中国太保	10,200	290,904.00	0.02
180	002230	科大讯飞	7,100	289,964.00	0.02
181	600406	国电南瑞	12,400	283,340.00	0.02
182	601229	上海银行	31,400	272,552.00	0.02
183	000301	东方盛虹	22,700	259,915.00	0.02
184	600436	片仔癀	2,300	251,344.00	0.02
185	601988	中国银行	43,500	248,820.00	0.02
186	600549	厦门钨业	2,900	247,080.00	0.02
187	600016	民生银行	73,500	236,670.00	0.02

188	688388	嘉元科技	5,200	228,800.00	0.02
189	600941	中国移动	2,600	223,938.00	0.02
190	600660	福耀玻璃	4,300	216,892.00	0.02
191	000657	中钨高新	2,200	210,584.00	0.02
192	000425	徐工机械	26,000	210,340.00	0.02
193	601919	中远海控	15,200	201,552.00	0.02
194	601728	中国电信	38,700	200,853.00	0.02
195	002429	兆驰股份	19,000	197,410.00	0.02
196	300959	线上线下	1,300	192,153.00	0.02
197	603195	公牛集团	4,900	191,835.00	0.02
198	601169	北京银行	34,800	170,520.00	0.01
199	600938	中国海油	6,200	168,330.00	0.01
200	000975	山金国际	9,900	168,300.00	0.01
201	000630	铜陵有色	26,000	165,360.00	0.01
202	603778	国晟科技	13,300	163,590.00	0.01
203	603501	豪威集团	1,700	161,245.00	0.01
204	300054	鼎龙股份	1,500	158,955.00	0.01
205	002195	岩山科技	23,700	154,998.00	0.01
206	603392	万泰生物	5,300	142,941.00	0.01
207	002709	天赐材料	2,700	138,861.00	0.01
208	600350	山东高速	11,400	126,882.00	0.01
209	600690	海尔智家	5,900	120,419.00	0.01
210	000969	安泰科技	4,700	115,338.00	0.01
211	601600	中国铝业	12,600	103,572.00	0.01
212	000807	云铝股份	2,600	57,564.00	0.00
213	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.00
214	688235	百济神州	200	50,922.00	0.00
215	688332	中科蓝讯	296	46,620.00	0.00
216	300953	震裕科技	140	18,718.00	0.00
217	301031	中熔电气	148	17,678.60	0.00
218	001339	智微智能	130	13,296.40	0.00
219	603296	华勤技术	140	10,397.80	0.00
220	300037	新宙邦	100	9,285.00	0.00
221	002768	国恩股份	148	7,704.88	0.00
222	605117	德业股份	60	6,370.80	0.00
223	002518	科士达	100	5,359.00	0.00
224	600298	安琪酵母	100	3,620.00	0.00
225	300207	欣旺达	100	1,899.00	0.00
226	603093	南华期货	100	1,815.00	0.00
227	605338	巴比食品	100	1,790.00	0.00
228	002155	湖南黄金	67	1,599.29	0.00
229	600882	妙可蓝多	100	1,599.00	0.00
230	600012	皖通高速	100	1,576.00	0.00

231	603162	海通发展	148	1,327.56	0.00
232	000708	中信特钢	100	1,262.00	0.00
233	600415	小商品城	100	1,016.00	0.00
234	601963	重庆银行	100	1,008.00	0.00
235	601878	浙商证券	100	950.00	0.00
236	002911	佛燃能源	100	949.00	0.00
237	301109	军信股份	60	747.60	0.00
238	601117	中国化学	100	735.00	0.00
239	603969	银龙股份	100	727.00	0.00
240	002120	韵达股份	100	636.00	0.00
241	002956	西麦食品	28	581.28	0.00
242	601139	深圳燃气	100	566.00	0.00
243	600019	宝钢股份	100	543.00	0.00
244	601766	中国中车	100	520.00	0.00
245	600480	凌云股份	60	498.60	0.00
246	601658	邮储银行	100	493.00	0.00
247	300458	全志科技	12	473.52	0.00
248	600496	精工钢构	100	310.00	0.00
249	300015	爱尔眼科	9	74.34	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	300750	宁德时代	7,208,665.00	0.47
2	688256	寒武纪	7,175,348.30	0.46
3	300476	胜宏科技	6,196,484.00	0.40
4	300308	中际旭创	5,922,453.00	0.38
5	603993	洛阳钼业	5,758,079.00	0.37
6	601088	中国神华	5,452,039.00	0.35
7	603986	兆易创新	5,432,204.00	0.35
8	688041	海光信息	5,380,324.24	0.35
9	300502	新易盛	5,340,361.00	0.34
10	600276	恒瑞医药	5,303,390.00	0.34
11	603259	药明康德	5,209,855.00	0.34
12	600111	北方稀土	5,175,332.00	0.33
13	300059	东方财富	4,890,504.00	0.32
14	002709	天赐材料	4,522,224.00	0.29
15	601318	中国平安	4,197,390.00	0.27
16	688981	中芯国际	4,091,327.31	0.26
17	601601	中国太保	4,068,269.00	0.26
18	000725	京东方 A	3,832,453.00	0.25

19	002475	立讯精密	3,803,011.00	0.25
20	601600	中国铝业	3,690,584.00	0.24

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	18,406,810.00	1.19
2	600519	贵州茅台	14,501,384.55	0.94
3	601318	中国平安	12,487,606.00	0.81
4	601899	紫金矿业	10,413,367.66	0.67
5	300308	中际旭创	9,853,164.00	0.64
6	600036	招商银行	9,430,417.82	0.61
7	688256	寒武纪	8,889,637.93	0.57
8	002594	比亚迪	7,793,037.00	0.50
9	000858	五粮液	7,738,006.86	0.50
10	601288	农业银行	7,622,365.00	0.49
11	600900	长江电力	7,606,439.49	0.49
12	601857	中国石油	7,572,451.00	0.49
13	601088	中国神华	7,538,716.68	0.49
14	601138	工业富联	7,244,130.40	0.47
15	603993	洛阳钼业	7,212,922.00	0.47
16	688041	海光信息	7,105,788.56	0.46
17	000333	美的集团	7,081,395.00	0.46
18	002415	海康威视	6,595,154.40	0.43
19	002475	立讯精密	6,232,523.00	0.40
20	600276	恒瑞医药	5,984,914.00	0.39

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	420,766,280.03
卖出股票收入（成交）总额	474,139,878.21

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	240,136,394.30	20.39
2	央行票据	-	-

3	金融债券	328,124,282.74	27.87
	其中：政策性金融债	30,099,476.71	2.56
4	企业债券	30,750,498.63	2.61
5	企业短期融资券	104,110,740.81	8.84
6	中期票据	195,952,615.33	16.64
7	可转债（可交换债）	55,874,883.99	4.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	954,949,415.80	81.10

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	019771	25 国债 06	500,000	50,400,232.88	4.28
2	019792	25 国债 19	460,000	46,482,647.12	3.95
3	2128042	21 兴业银行二级 02	400,000	41,199,866.30	3.50
4	019797	25 国债 24	350,000	35,328,213.70	3.00
5	102101332	21 粤交投 MTN003	300,000	31,008,361.64	2.63

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

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

报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

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

招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到监管部门处

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同约定备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	101,495.45
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,992,932.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,094,427.92

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	123255	鼎龙转债	6,700,066.85	0.57
2	118058	微导转债	5,455,642.19	0.46
3	118059	颀中转债	3,847,878.08	0.33
4	118060	瑞可转债	3,793,805.75	0.32
5	123241	欧通转债	3,755,992.11	0.32
6	118062	天准转债	3,744,217.32	0.32
7	123245	集智转债	3,618,021.37	0.31
8	118030	睿创转债	3,566,651.51	0.30
9	118051	皓元转债	3,511,181.92	0.30
10	113667	春 23 转债	3,230,084.93	0.27
11	118040	宏微转债	2,971,933.15	0.25
12	127096	泰坦转债	2,908,823.01	0.25
13	127080	声迅转债	2,827,814.79	0.24
14	127092	运机转债	2,048,002.19	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 (%)
泰信双息 双利债券 A	129	449,041.67	49,624,655.23	85.67	8,301,719.83	14.33
泰信双息 双利债券 C	3,524	268,103.08	97,419,293.42	10.31	847,375,975.17	89.69
合计	3,653	274,492.65	147,043,948.65	14.66	855,677,695.00	85.34

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	泰信双息双利债券 A	-	-
	泰信双息双利债券 C	290,720.00	0.0308
	合计	290,720.00	0.0290

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	泰信双息双利债券 A	0
	泰信双息双利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	泰信双息双利债券 A	0
	泰信双息双利债券 C	10~50

	合计	10~50
--	----	-------

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	泰信双息双利债券 A	泰信双息双利债券 C
基金合同生效日 （2007 年 10 月 31 日）基金份额总额	-	382,550,774.21
本报告期期初基金份额总额	413,918,963.17	964,503,113.73
本报告期基金总申购份额	35,806,879.88	1,305,739,920.42
减：本报告期基金总赎回份额	391,799,467.99	1,325,447,765.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,926,375.06	944,795,268.59

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、自 2026 年 2 月 10 日起，张芸红不再担任首席财务官。具体详情参见 2026 年 2 月 10 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。 2、自 2026 年 3 月 10 日起，段晓旭担任首席财务官。具体详情参见 2026 年 3 月 10 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。 3、自 2026 年 6 月 22 日起，刘玉成担任首席信息官，总经理张秉麟不再代任首席信息官职务。具体详情参见 2026 年 6 月 22 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司

网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

上述人事变动已按相关规定进行备案。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

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(%)	
国联民生证券	3	894,906,158.24	100.00	399,045.05	100.00	—
财通证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—

东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
金融街证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	1	-	-	-	-	-

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：西部证券深圳 017433，兴业证券上海 44756，兴业证券深圳 008356，长江证券深圳 019611，国海证券上海 64587，国海证券深圳 017130，长城证券上海 37080，长城证券深圳 022811，华福证券深圳 019967；退租交易单元：华宝证券上海 45363，华宝证券深圳 005927。

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(%)
国联民生证券	762,802,980.61	100.00	1,871,000,000.00	100.00	-	-

财通证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-
金融街 证券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

甬兴证 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泰信双息双利债券型证券投资基金新增国泰海通证券股份有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 5 日
2	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	2026 年 1 月 19 日
3	泰信双息双利债券型证券投资基金 2025 年第四季度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 21 日
4	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
5	泰信双息双利债券型证券投资基金更新招募说明书（2026 年 1 号）及产品资料概要	规定报刊及规定网站	2026 年 2 月 27 日
6	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
7	泰信双息双利债券型证券投资基金 2025 年年度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 30 日
8	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
9	泰信双息双利债券型证券投资基金 2026 年第一季度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 21 日
10	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	泰信基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	规定报刊及规定网站	2026 年 6 月 27 日
12	泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同	规定报刊及规定网站	2026 年 6 月 27 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、原泰信中短期债券投资基金基金份额持有人大会经中国证监会证监基金字[2007]293 号文核准的文件

- 2、《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信双息双利债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信双息双利债券型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

12.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988，021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日