

泰康润颐 63 个月定期开放债券型  
证券投资基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 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              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 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             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>39</b> |
| 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       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 39        |
| 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      | 40        |
| 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   | 40        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 40        |
| 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 .....    | 40        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 40        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 41        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 42        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 42        |
| 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 .....      | 42        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>43</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 44        |
| 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 .....      | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 44        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 44        |
| 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 .....         | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 44        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 48        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>49</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 .....    | 49        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 49        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>51</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 51        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 51        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 基金名称       | 泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 泰康润颐 63 个月定开债券          |
| 基金主代码      | 007600                  |
| 基金运作方式     | 契约型定期开放式                |
| 基金合同生效日    | 2020 年 7 月 27 日         |
| 基金管理人      | 泰康基金管理有限公司              |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司              |
| 报告期末基金份额总额 | 7,989,997,094.67 份      |
| 基金合同存续期    | 不定期                     |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在封闭期采用买入持有到期策略，投资于到期日（或回售期限）在所在封闭期结束之前的固定收益类金融工具，力求实现基金资产的持续稳定增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 投资策略   | <p>本基金按 63 个月为封闭周期进行投资运作。本基金在每个封闭期初，将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境进行封闭周期组合构建。在封闭期内，本基金采用买入并持有到期策略，所投资金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资金融资产的到期日（或回售期限）不得晚于该封闭期的最后一日，力求基金资产在开放前可完全变现。</p> <p>本基金将基于宏观经济分析及对债券市场的判断，在利率预期分析及久期配置范围确定的基础上，在银行存款、信用债、利率债等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。</p> <p>开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p> |
| 业绩比较基准 | 在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中债 5 年期国开债到期收益率。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中低风险收益品种。                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

### 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          |      | 泰康基金管理有限公司             | 招商银行股份有限公司                  |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 陈玮光                    | 张姗                          |
|             | 联系电话 | 010-89620366           | 0755-83077987               |
|             | 电子邮箱 | tkfchenwg06@tkfunds.cn | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 4001895522             | 95555                       |

|       |                                   |                      |
|-------|-----------------------------------|----------------------|
| 传真    | 010-89620100                      | 0755-83195201        |
| 注册地址  | 北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 办公地址  | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层        | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码  | 100033                            | 518040               |
| 法定代表人 | 金志刚                               | 缪建民                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                    |
|---------------------|--------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》            |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.tkfunds.com.cn |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人办公地、基金托管人的住所  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                       |
|--------|------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 泰康基金管理有限公司 | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 155,555,433.92                      |
| 本期利润          | 155,555,433.92                      |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0195                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.82%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.84%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 546,775,784.62                      |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0684                              |
| 期末基金资产净值      | 8,536,772,879.29                    |
| 期末基金份额净值      | 1.0684                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 11.23%                              |

注：（1）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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

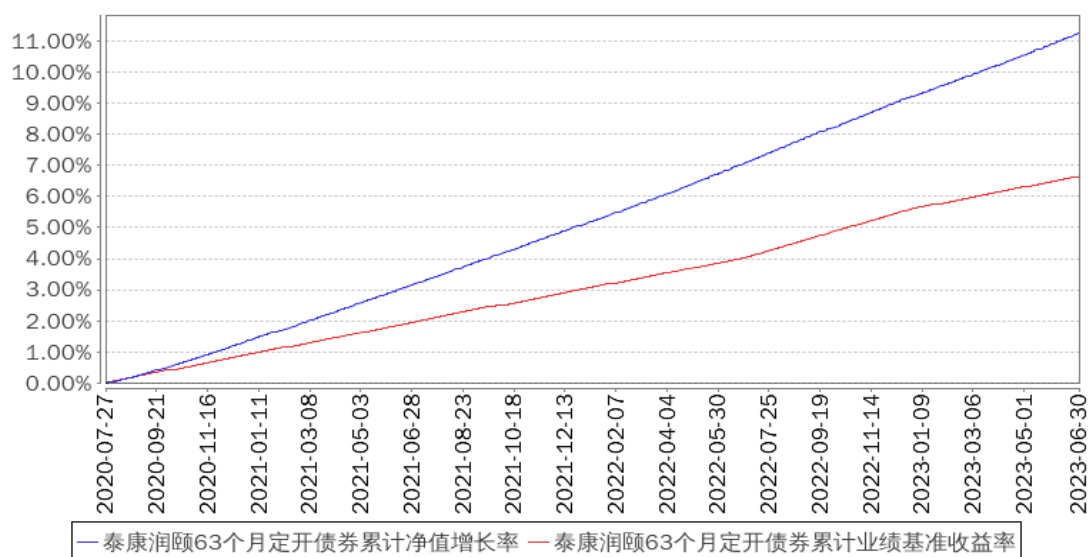
3.2 基金净值表现

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

| 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      | 0.30%    | 0.01%       | 0.26%      | 0.00%         | 0.04% | 0.01% |
| 过去三个月      | 0.94%    | 0.01%       | 0.79%      | 0.00%         | 0.15% | 0.01% |
| 过去六个月      | 1.84%    | 0.01%       | 1.56%      | 0.00%         | 0.28% | 0.01% |
| 过去一年       | 3.87%    | 0.01%       | 3.15%      | 0.00%         | 0.72% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.23%   | 0.01%       | 9.23%      | 0.00%         | 2.00% | 0.01% |

### 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

泰康润颐63个月定开债券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 2020 年 07 月 27 日生效。

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.3 其他指标

无。



## § 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

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）前身为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）公募事业部，2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。2021 年 9 月 1 日，泰康资产获得证监会批准设立子公司泰康基金，2021 年 10 月 12 日，泰康基金完成工商注册。2022 年 11 月 18 日，泰康资产旗下公募基金产品的基金管理人变更为泰康基金。

泰康基金注册地为北京，注册资本为 1.2 亿元人民币。截至 2023 年 6 月 30 日，泰康基金共管理 72 只证券投资基金，已形成包括货币、债券、偏债混合、偏股混合、主动权益、沪港深系列、主动量化及被动指数、FOF 基金等不同类型的产品系列，并在养老目标基金、宽基及细分行业主题 ETF、以及双碳、科技、大健康、消费 2+2 赛道等方面均进行了战略布局，为投资者提供了丰富多元的投资选择。

#### 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 经惠云 | 本基金基金经理 | 2020 年 7 月 27 日 | —    | 14 年   | 经惠云于 2016 年 10 月加入泰康公募，现任泰康基金固定收益基金经理。曾任银华基金管理股份有限公司固定收益部基金经理、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理等职务。2017 年 12 月 25 日至 2020 年 1 月 6 日担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 25 日至今担任泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 5 月 15 日至今担任泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 4 日至今担任泰康信用精选债券型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 25 日至今担任泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 8 日至今担任泰康瑞丰纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 24 日至今担任泰康长江经济带债券型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 27 日至 |

|  |  |  |  |  |                                                                     |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 今担任泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 1 日至今担任泰康招享混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------|

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

宏观经济在 2023 年上半年呈现出先复苏、再环比走弱的特征。一季度，得益于经济场景的恢复、积压需求的回补，经济呈现出复苏态势。但随着回补需求的逐步释放，居民和企业部门的信心恢复速度偏慢，外部经济和金融风险等不确定性有所发酵，内生增长动能不足的问题在二季度逐步凸显。地产、就业市场、出口等部门都呈现出一定压力，物价指数走低，库存主动去化，政策继续坚持高质量发展。

债券市场方面，债券收益率在 2023 年上半年震荡走低。利率债在 1-2 月由于信贷需求旺盛、资金利率不低、经济复苏的背景下，表现受到一定压制；但进入三月份，随着基本面、资金面等拐点逐步显现，利率见顶回落，3 月份降准、6 月份降息又进一步促进了收益率下行。除了基本面驱动的逻辑外，上半年利率的另外一个核心驱动是负债成本，随着银行息差逐步下降，银行降低

存款利率的趋势明显，提供了银行体系对于低利率环境的接受能力。

具体固收投资上，报告期内本基金严格按照基金合同约定，采取稳健积极的持有到期策略。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0684 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.84%; 同期业绩比较基准增长率为 1.56%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计经济能在政策的作用下逐步筑底企稳，但缺少向上弹性。当前稳增长的政策基调越发明晰，地产政策也将逐步优化。虽然总体政策基调是在高质量发展的框架下进行的，但政策也更加直面困难，基调也比之前积极。此外，名义库存去化速度较快，工业品价格也有望筑底。往长看，本次经济修复或局限于信心筑底和库存修复，需求侧亮点有限。

对于债券市场，预计下半年利率维持震荡走势，尽管利率下行的空间和流畅程度或不及今年二季度，但大方向没有发生改变，更多的是节奏上需要适应经济发展和投资者行为调整的需要。内生动能偏弱的现实很难改变，银行降低存款利率、以更好地服务于实体成本包括房贷利率的下降，都是大势所趋。

我们将紧密跟踪经济和市场的动态变化，力争把握机会、规避风险，为基金持有人取得较好回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部）、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括上海、深圳、北京证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金应分配且已分配利润 172,184,437.41 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 232,675.48                     | 208,410.19                       |
| 结算备付金         |            | 216,107,534.30                 | 215,167,469.99                   |
| 存出保证金         |            | —                              | —                                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | —                              | —                                |
| 其中：股票投资       |            | —                              | —                                |
| 基金投资          |            | —                              | —                                |
| 债券投资          |            | —                              | —                                |
| 资产支持证券投资      |            | —                              | —                                |
| 贵金属投资         |            | —                              | —                                |
| 其他投资          |            | —                              | —                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | —                              | —                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | —                              | —                                |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | 13,260,865,949.53              | 13,071,022,775.08                |
| 其中：债券投资       |            | 13,260,865,949.53              | 13,071,022,775.08                |
| 资产支持证券投资      |            | —                              | —                                |
| 其他投资          |            | —                              | —                                |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | —                              | —                                |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | —                              | —                                |
| 应收清算款         |            | 229,162.35                     | 27,476.10                        |
| 应收股利          |            | —                              | —                                |
| 应收申购款         |            | —                              | —                                |
| 递延所得税资产       |            | —                              | —                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | —                              | —                                |
| 资产总计          |            | 13,477,435,321.66              | 13,286,426,131.36                |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2022 年 12 月 31 日</b> |
| <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     |            | 4,938,792,326.63               | 4,731,241,632.14                 |
| 应付清算款         |            | 226,159.61                     | —                                |
| 应付赎回款         |            | —                              | —                                |

|             |          |                   |                   |
|-------------|----------|-------------------|-------------------|
| 应付管理人报酬     |          | 1,050,868.94      | 1,088,016.14      |
| 应付托管费       |          | 350,289.65        | 362,672.05        |
| 应付销售服务费     |          | -                 | -                 |
| 应付投资顾问费     |          | -                 | -                 |
| 应交税费        |          | -                 | -                 |
| 应付利润        |          | -                 | -                 |
| 递延所得税负债     |          | -                 | -                 |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 242,797.54        | 331,933.91        |
| 负债合计        |          | 4,940,662,442.37  | 4,733,024,254.24  |
| <b>净资产：</b> |          |                   |                   |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 7,989,997,094.67  | 7,989,997,089.27  |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -                 | -                 |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | 546,775,784.62    | 563,404,787.85    |
| 净资产合计       |          | 8,536,772,879.29  | 8,553,401,877.12  |
| 负债和净资产总计    |          | 13,477,435,321.66 | 13,286,426,131.36 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0684 元，基金份额总额 7,989,997,094.67 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 215,521,010.60                           | 216,438,992.34                                |
| 1. 利息收入           |          | 215,521,010.60                           | 216,438,992.34                                |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 1,339,521.50                             | 1,727,296.95                                  |
| 债券利息收入            |          | 214,181,489.10                           | 214,629,832.36                                |
| 资产支持证券利息收入        |          | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入        |          | -                                        | 81,863.03                                     |
| 证券出借利息收入          |          | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入            |          | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | -                                        | -                                             |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.14 | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益            |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益            | 6.4.7.15 | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券投资<br>收益    | 6.4.7.16 | -                                        | -                                             |

|                            |            |                |                |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.17   | -              | -              |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.18   | -              | -              |
| 股利收益                       | 6.4.7.19   | -              | -              |
| 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）     | 6.4.7.20   | -              | -              |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -              | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.21   | -              | -              |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 59,965,576.68  | 57,422,236.62  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 6,344,319.95   | 6,235,455.29   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 2,114,773.35   | 2,078,485.02   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -              | -              |
| 4. 投资顾问费                   |            | -              | -              |
| 5. 利息支出                    |            | 51,357,492.52  | 48,978,638.11  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 51,357,492.52  | 48,978,638.11  |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | 22,314.65      | 3,880.07       |
| 7. 税金及附加                   |            | -              | -              |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 126,676.21     | 125,778.13     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 155,555,433.92 | 159,016,755.72 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 155,555,433.92 | 159,016,755.72 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 155,555,433.92 | 159,016,755.72 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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（基金净值） | 7,989,997,089.27                      | -      | 563,404,787.85 | 8,553,401,877.12 |



|                                          |                                            |        |                 |                  |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -               | -                |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -               | -                |
| 其他                                       | -                                          | -      | -               | -                |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 7,989,997,089.27                           | -      | 563,404,787.85  | 8,553,401,877.12 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 5.40                                       | -      | -16,629,003.23  | -16,628,997.83   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | -      | 155,555,433.92  | 155,555,433.92   |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 5.40                                       | -      | 0.26            | 5.66             |
| 其中：1. 基金申购款                              | 5.40                                       | -      | 0.26            | 5.66             |
| 2. 基金赎回款                                 | -                                          | -      | -               | -                |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                          | -      | -172,184,437.41 | -172,184,437.41  |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                                          | -      | -               | -                |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 7,989,997,094.67                           | -      | 546,775,784.62  | 8,536,772,879.29 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）                          | 7,989,997,087.07                           | -      | 322,308,175.74  | 8,312,305,262.81 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -304,544.23     | -304,544.23      |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -               | -                |

|                                          |                  |   |                |                  |
|------------------------------------------|------------------|---|----------------|------------------|
| 其他                                       | -                | - | -              | -                |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 7,989,997,087.07 | - | 322,003,631.51 | 8,312,000,718.58 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 2.20             | - | 74,322,786.95  | 74,322,789.15    |
| （一）、综合收益总额                               | -                | - | 159,016,755.72 | 159,016,755.72   |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 2.20             | - | 0.11           | 2.31             |
| 其中：1. 基金申购款                              | 2.20             | - | 0.11           | 2.31             |
| 2. 基金赎回款                                 | -                | - | -              | -                |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                | - | -84,693,968.88 | -84,693,968.88   |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                | - | -              | -                |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 7,989,997,089.27 | - | 396,326,418.46 | 8,386,323,507.73 |

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：

金志刚

金志刚

李俊佑

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

泰康润颐 63 个月定期开放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[2020]1047 号《关于准予泰康润颐 63 个月定期开放

债券型证券投资基金注册的批复》核准，由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 7,989,997,085.60 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2000610 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,989,997,085.60 份基金份额，无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行的金融工具，包括债券资产(包括但不限于国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、金融债、企业债、公司债券、公开发行的次级债、分离交易可转债的纯债部分、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具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。本基金不在二级市场买入股票等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，同时本基金不参与可转债、可交换债投资。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前 3 个月至开放期结束后 3 个月内不受前述比例限制。在开放期内，本基金保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券(现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。在封闭期，不受前述 5%的限制。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中债 5 年期国开债到期收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以非货物期货结

算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4)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 银行存款

单位:人民币元

| 项目              | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 活期存款            | 232,675.48             |
| 等于: 本金          | 232,567.63             |
| 加: 应计利息         | 107.85                 |
| 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              | 232,675.48             |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

无。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

###### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

###### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |               |                |            |                   |
|--------|-------|------------------------|---------------|----------------|------------|-------------------|
|        |       | 初始成本                   | 利息调整          | 应计利息           | 减值准备       | 账面价值              |
| 债券     | 交易所市场 | 2,450,000,000.00       | 4,639,411.91  | 62,390,630.12  | 326,485.80 | 2,516,703,556.23  |
|        | 银行间市场 | 10,406,000,000.00      | 61,179,015.25 | 276,983,378.05 | -          | 10,744,162,393.30 |
|        | 小计    | 12,856,000,000.00      | 65,818,427.16 | 339,374,008.17 | 326,485.80 | 13,260,865,949.53 |
| 资产支持证券 |       | -                      | -             | -              | -          | -                 |
| 其他     |       | -                      | -             | -              | -          | -                 |
| 合计     |       | 12,856,000,000.00      | 65,818,427.16 | 339,374,008.17 | 326,485.80 | 13,260,865,949.53 |

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

| 减值准备      | 第一阶段           | 第二阶段                 | 第三阶段                 | 合计         |
|-----------|----------------|----------------------|----------------------|------------|
|           | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值) |            |
| 期初余额      | 304,171.15     | -                    | -                    | 304,171.15 |
| 本期从其他阶段转入 | -              | -                    | -                    | -          |
| 本期转出至其他阶段 | -              | -                    | -                    | -          |
| 本期新增      | 22,314.65      | -                    | -                    | 22,314.65  |
| 本期转回      | -              | -                    | -                    | -          |

|      |            |   |   |            |
|------|------------|---|---|------------|
| 其他变动 | -          | - | - | -          |
| 期末余额 | 326,485.80 | - | - | 326,485.80 |

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023 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      | 129,659.19             |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 129,659.19             |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 113,138.35             |
| 合计          | 242,797.54             |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 7,989,997,089.27                      | 7,989,997,089.27 |
| 本期申购          | 5.40                                  | 5.40             |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                |
| 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           | 7,989,997,094.67 | 7,989,997,094.67 |

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 上年度末           | 563,404,787.85  | -     | 563,404,787.85  |
| 本期利润           | 155,555,433.92  | -     | 155,555,433.92  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 0.26            | -     | 0.26            |
| 其中：基金申购款       | 0.26            | -     | 0.26            |
| 基金赎回款          | -               | -     | -               |
| 本期已分配利润        | -172,184,437.41 | -     | -172,184,437.41 |
| 本期末            | 546,775,784.62  | -     | 546,775,784.62  |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 10,572.44                             |
| 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 | 1,328,949.06                          |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 1,339,521.50                          |

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。



#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

无。

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

无。

## 6.4.7.21 其他收入

无。

## 6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 银行存款     | -                                     |
| 买入返售金融资产 | -                                     |
| 债权投资     | 22,314.65                             |
| 其他债权投资   | -                                     |
| 其他       | -                                     |
| 合计       | 22,314.65                             |

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 44,630.98                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行费用    | 3,602.86                              |
| 债券帐户维护费 | 18,000.00                             |
| 其他      | 935.00                                |
| 合计      | 126,676.21                            |

## 6.4.7.24 分部报告

无。

## 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，本基金并无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的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

本报告期与基金管理人存在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             |
|--------------------|---------------------|
| 泰康基金管理有限公司         | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |
| 泰康保险集团股份有限公司       | 基金管理人的最终控股母公司       |
| 泰康资产管理有限责任公司       | 基金管理人控股股东           |
| 嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东            |
| 嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东            |
| 嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东            |
| 嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东            |
| 嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东            |

注：下述关联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

无。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

### 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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 6,344,319.95                             | 6,235,455.29                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 714,574.46                               | 702,311.29                                    |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,114,773.35                          | 2,078,485.02                               |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日      |        |      |       |      |                |              |
|--------------------------------------------|--------|------|-------|------|----------------|--------------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购          |              |
|                                            | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额           | 利息支出         |
| 招商银行                                       | -      | -    | -     | -    | -              | -            |
| 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |      |       |      |                |              |
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购          |              |
|                                            | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额           | 利息支出         |
| 招商银行                                       | -      | -    | -     | -    | 133,036,040.00 | 9,698,741.66 |

#### 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

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 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

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 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

| 关联方名称 | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |                                 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |                                 |
|-------|------------------------|---------------------------------|--------------------------|---------------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份<br>额<br>占基金总份<br>额的比例（%） | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份<br>额<br>占基金总份<br>额的比例（%） |
| 招商银行  | 1,999,999,000.00       | 25.0313                         | 1,999,999,000.00         | 25.0313                         |

## 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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 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    |
| 招商银行  | 232,675.48                            | 10,572.44 | 200,537,830.87                             | 16,916.95 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记<br>日         | 除息日 |                       | 每 10 份<br>基金份<br>额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额   | 再投<br>资形<br>式<br>发<br>放<br>总<br>额 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
|----|-----------------------|-----|-----------------------|---------------------------|----------------|-----------------------------------|----------------|----|
|    |                       | 场内  | 场外                    |                           |                |                                   |                |    |
| 1  | 2023<br>年 3 月<br>16 日 | -   | 2023<br>年 3 月<br>16 日 | 0.2155                    | 172,184,431.75 | 5.66                              | 172,184,437.41 | -  |
| 合计 | -                     | -   | -                     | 0.2155                    | 172,184,431.75 | 5.66                              | 172,184,437.41 | -  |

## 6.4.12 期末（2023 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

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,772,923,658.13 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）      | 期末估值总额           |
|--------|----------|----------------|--------|------------|------------------|
| 150218 | 15 国开 18 | 2023 年 7 月 3 日 | 103.73 | 3,349,000  | 347,394,132.18   |
| 180214 | 18 国开 14 | 2023 年 7 月 3 日 | 104.42 | 3,300,000  | 344,579,539.70   |
| 200315 | 20 进出 15 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.47 | 3,158,000  | 323,586,737.36   |
| 200405 | 20 农发 05 | 2023 年 7 月 3 日 | 98.31  | 1,064,000  | 104,602,623.98   |
| 200315 | 20 进出 15 | 2023 年 7 月 4 日 | 102.47 | 2,106,000  | 215,792,802.05   |
| 200405 | 20 农发 05 | 2023 年 7 月 4 日 | 98.31  | 1,527,000  | 150,120,495.14   |
| 200408 | 20 农发 08 | 2023 年 7 月 4 日 | 102.45 | 3,158,000  | 323,537,435.67   |
| 150314 | 15 进出 14 | 2023 年 7 月 5 日 | 104.16 | 10,527,000 | 1,096,521,286.60 |
| 180214 | 18 国开 14 | 2023 年 7 月 5 日 | 104.42 | 1,053,000  | 109,952,198.58   |
| 合计     |          |                |        | 29,242,000 | 3,016,087,251.26 |

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,165,868,668.50 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融

工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制定了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级 AA 级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至 C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                   | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                   | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                   | 0.00                     |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                   | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                   | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                   | 0.00                     |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                   | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                   | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                   | 0.00                     |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

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 | 上年度末 |
|--------|-----|------|
|--------|-----|------|



|        | 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-----------------|------------------|
| AAA    | 0.00            | 0.00             |
| AAA 以下 | 0.00            | 0.00             |
| 未评级    | 0.00            | 0.00             |
| 合计     | 0.00            | 0.00             |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 0.00                   | 0.00                     |
| AAA 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                   | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                   | 0.00                     |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 0.00                   | 0.00                     |
| AAA 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                   | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                   | 0.00                     |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。在本基金开放日，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 2023 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，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 2023 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通过合理配置投资组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。本基金主要投资于固定利率类的固定收益品种，因此很大程度上独立于市场利率变化。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 年 6 月 30 日   | 1 年以内              | 1-5 年             | 5 年以上 | 不计息           | 合计                |
|--------------------------|--------------------|-------------------|-------|---------------|-------------------|
| 资产                       |                    |                   |       |               |                   |
| 银行存款                     | 232,675.48         | -                 | -     | -             | 232,675.48        |
| 结算备付金                    | 216,107,534.30     | -                 | -     | -             | 216,107,534.30    |
| 债权投资                     | -13,260,865,949.53 | -                 | -     | -             | 13,260,865,949.53 |
| 应收清算款                    | -                  | -                 | -     | 229,162.35    | 229,162.35        |
| 资产总计                     | 216,340,209.78     | 13,260,865,949.53 | -     | 229,162.35    | 13,477,435,321.66 |
| 负债                       |                    |                   |       |               |                   |
| 应付管理人报酬                  | -                  | -                 | -     | 1,050,868.94  | 1,050,868.94      |
| 应付托管费                    | -                  | -                 | -     | 350,289.65    | 350,289.65        |
| 应付清算款                    | -                  | -                 | -     | 226,159.61    | 226,159.61        |
| 卖出回购金融资产款                | 4,938,792,326.63   | -                 | -     | -             | 4,938,792,326.63  |
| 其他负债                     | -                  | -                 | -     | 242,797.54    | 242,797.54        |
| 负债总计                     | 4,938,792,326.63   | -                 | -     | 1,870,115.74  | 4,940,662,442.37  |
| 利率敏感度缺口                  | -4,722,452,116.85  | 13,260,865,949.53 | -     | -1,640,953.39 | 8,536,772,879.29  |
| 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 | 1 年以内              | 1-5 年             | 5 年以上 | 不计息           | 合计                |
| 资产                       |                    |                   |       |               |                   |
| 银行存款                     | 208,410.19         | -                 | -     | -             | 208,410.19        |
| 结算备付金                    | 215,167,469.99     | -                 | -     | -             | 215,167,469.99    |
| 债权投资                     | -13,071,022,775.08 | -                 | -     | -             | 13,071,022,775.08 |
| 应收清算款                    | -                  | -                 | -     | 27,476.10     | 27,476.10         |
| 资产总计                     | 215,375,880.18     | 13,071,022,775.08 | -     | 27,476.10     | 13,286,426,131.36 |
| 负债                       |                    |                   |       |               |                   |
| 应付管理人报酬                  | -                  | -                 | -     | 1,088,016.14  | 1,088,016.14      |
| 应付托管费                    | -                  | -                 | -     | 362,672.05    | 362,672.05        |
| 卖出回购金融资产款                | 4,731,241,632.14   | -                 | -     | -             | 4,731,241,632.14  |
| 其他负债                     | -                  | -                 | -     | 331,933.91    | 331,933.91        |

|         |                   |                   |   |               |                  |
|---------|-------------------|-------------------|---|---------------|------------------|
| 负债总计    | 4,731,241,632.14  | -                 | - | 1,782,622.10  | 4,733,024,254.24 |
| 利率敏感度缺口 | -4,515,865,751.96 | 13,071,022,775.08 | - | -1,755,146.00 | 8,553,401,877.12 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值变动对基金利润总额和净值产生的影响 |                             |                        |
|----|---------------------------------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                                               | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                                         | 本期末（2023 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率上调<br>0.25%                                         | -67,655,401.97              | -82,089,653.85         |
|    | 市场利率下调<br>0.25%                                         | 68,181,552.69               | 82,823,594.30          |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期末及上年度末均未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于本期末，债权投资账面价值为 13,260,865,949.53 元，公允价值为 13,529,051,008.17 元；于上年度末，持有至到期投资账面价值为 13,071,022,775.08 元，公允价值为 13,321,115,621.92 元。

债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《关于固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的上述投资的公允价值均属

于第二层次。

#### 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              | —                 | —             |
|    | 其中：股票             | —                 | —             |
| 2  | 基金投资              | —                 | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 13,260,865,949.53 | 98.39         |
|    | 其中：债券             | 13,260,865,949.53 | 98.39         |
|    | 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      | 216,340,209.78    | 1.61          |
| 8  | 其他各项资产            | 229,162.35        | 0.00          |
| 9  | 合计                | 13,477,435,321.66 | 100.00        |

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期内未买入股票。

#### 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

本基金本报告期内未卖出股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未买入及卖出股票。

### 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      | -                 | -            |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 11,586,906,261.24 | 135.73       |
|    | 其中：政策性金融债 | 11,586,906,261.24 | 135.73       |
| 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） | -                 | -            |
| 8  | 同业存单      | -                 | -            |
| 9  | 其他        | 1,673,959,688.29  | 19.61        |
| 10 | 合计        | 13,260,865,949.53 | 155.34       |

注：本基金所列示其他债券均为地方政府债。

## 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  | 150218 | 15 国开 18 | 29,500,000 | 3,060,055,807.46 | 35.85        |
| 2  | 180214 | 18 国开 14 | 24,660,000 | 2,574,948,923.91 | 30.16        |
| 3  | 150314 | 15 进出 14 | 19,600,000 | 2,041,589,932.30 | 23.92        |
| 4  | 200408 | 20 农发 08 | 12,600,000 | 1,290,871,339.29 | 15.12        |
| 5  | 200405 | 20 农发 05 | 8,600,000  | 845,472,336.72   | 9.90         |

## 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 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

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

无。



## 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

中国进出口银行因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为等原因在本报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外，其他发行主体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规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规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 | -          |
| 2  | 应收清算款 | 229,162.35 |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | -          |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 229,162.35 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§ 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>例 (%) | 持有份额     | 占总份额比例<br>(%) |
| 210          | 38,047,605.21 | 7,989,993,000.00 | 100.00         | 4,094.67 | -             |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 0.00       | 0.0000       |

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                                 | 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<br>门负责人持有本开放式基金 | 0                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                  |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2020 年 7 月 27 日）<br>基金份额总额 | 7,989,997,085.60 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 7,989,997,089.27 |
| 本报告期基金总申购份额                        | 5.40             |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | —                |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | —                |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 7,989,997,094.67 |

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金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

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 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，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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 (%) |    |
| 安信证券 | 4      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 财通证券 | 2      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 长江证券 | 2      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 德邦证券 | 2      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 东北证券 | 2      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 东方证券 | 2      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 东吴证券 | 2      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 东兴证券 | 2      | —    | —                | —         | —              | —  |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 方正证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 光大证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 广发证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 国海证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 国金证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 海通证券       | 6 | - | - | - | - | - |
| 华安证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 华西证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 汇丰前海<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 开源证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | 4 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 中邮证券       | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

## 2、交易单元的选择标准和程序

交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

（1）经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；（2）财务状况和经营状况良好；（3）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；（4）有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；（5）能及时

提供准确的信息资讯服务；(6) 满足基金运作的保密要求；(7) 符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力和服务质量进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行。

3、本报告期内本基金新增租用 30 个交易单元，国信证券上海证券交易所交易单元 1 个，国泰君安证券上海证券交易所交易单元 1 个，华安证券上海证券交易所交易单元 1 个，中信建投证券上海证券交易所交易单元 1 个，开源证券深圳证券交易所交易单元 1 个，国盛证券深圳证券交易所交易单元 1 个，国金证券深圳证券交易所交易单元 1 个，国海证券深圳证券交易所交易单元 1 个，中泰证券深圳证券交易所交易单元 1 个，中信建投深圳证券交易所交易单元 2 个，申万宏源证券深圳证券交易所交易单元 1 个，东吴证券深圳证券交易所交易单元 1 个，华创证券深圳证券交易所交易单元 1 个，华西证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，国联证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华福证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中邮证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，汇丰前海证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，财通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，海通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。本报告期内本基金减少租用 60 个交易单元，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东吴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，国盛证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华创证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，开源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，申万宏源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，天风证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，兴业证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，招商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，浙商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信建投证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，中信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，德邦证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，信达证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，汇丰前海证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，西部证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东北证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华西证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，国金证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华鑫证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，财通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，民生证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华安证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

## 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(%) |
| 安信证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 财通证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 长江证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 德邦证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东北证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东方证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东吴证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东兴证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 方正证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 光大证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 广发证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国海证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国金证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国联证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国盛证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国泰君安证券 | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国信证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 海通证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 华安证    | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |

|            |   |   |                        |        |   |   |
|------------|---|---|------------------------|--------|---|---|
| 券          |   |   |                        |        |   |   |
| 华创证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 华福证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 华泰证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 华西证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 华鑫证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 汇丰前<br>海证券 | - | - | -                      | -      | - | - |
| 开源证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 申万宏<br>源证券 | - | - | -                      | -      | - | - |
| 天风证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 西部证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 信达证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 兴业证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 招商证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 浙商证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 中金公<br>司   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 中泰证<br>券   | - | - | -                      | -      | - | - |
| 中信建<br>投证券 | - | - | -                      | -      | - | - |
| 中信证<br>券   | - | - | 208,650,100,<br>000.00 | 100.00 | - | - |
| 中邮证<br>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  | 泰康润颐 63 个月定期开放债券型证<br>券投资基金 2022 年第四季度报告 | 《上海证券报》；中国证<br>监会基金电子披露网站 | 2023 年 01 月 19 日 |



|   |                                       |                               |                  |
|---|---------------------------------------|-------------------------------|------------------|
|   |                                       | 及基金管理人网站                      |                  |
| 2 | 泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第一次分红公告 | 《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 03 月 15 日 |
| 3 | 泰康基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告                | 《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 03 月 17 日 |
| 4 | 泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2022 年年度报告    | 《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 03 月 30 日 |
| 5 | 泰康基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告                | 《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 04 月 21 日 |
| 6 | 泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第一季度报告  | 《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 04 月 21 日 |
| 7 | 泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告         | 《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 06 月 28 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

| 投资者类别                                                                                                                                     | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                      |      |      | 报告期末持有基金情况           |          |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|----------------------|------|------|----------------------|----------|
|                                                                                                                                           | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额                 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额                 | 份额占比 (%) |
| 机构                                                                                                                                        | 1              | 20230101<br>– 20230630  | 2,089,999<br>,000.00 | 0.00 | 0.00 | 2,089,999,000<br>.00 | 26.16    |
|                                                                                                                                           | 2              | 20230101<br>– 20230630  | 1,999,999<br>,000.00 | 0.00 | 0.00 | 1,999,999,000<br>.00 | 25.03    |
|                                                                                                                                           | 3              | 20230101<br>– 20230630  | 1,999,999<br>,000.00 | 0.00 | 0.00 | 1,999,999,000<br>.00 | 25.03    |
| 个人                                                                                                                                        | –              | –                       | –                    | –    | –    | –                    | –        |
| 产品特有风险                                                                                                                                    |                |                         |                      |      |      |                      |          |
| 当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。 |                |                         |                      |      |      |                      |          |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金注册的文件；
- （二）《泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- （三）《泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- （四）《泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- （五）《泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金产品资料概要》。

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《上海证券报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日