

# 泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起 式证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <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                 | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 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                    | 40        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 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>44</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 44        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 44        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 44        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 44        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>45</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 46        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 46        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 46        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 46        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 50        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>52</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 .....    | 52        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 52        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 53        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 53        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 53        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|            |                             |
|------------|-----------------------------|
| 基金名称       | 泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 泰康安悦纯债 3 月定开债券              |
| 基金主代码      | 005172                      |
| 基金运作方式     | 契约型定期开放式                    |
| 基金合同生效日    | 2017 年 11 月 1 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 | 655,993,916.09 份            |
| 基金合同存续期    | 不定期                         |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金利用定期开放的运作特性，通过积极主动的投资管理，在严格控制风险的基础上，追求超越业绩比较基准的收益水平。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 投资策略   | <p>在每个封闭期的建仓内，本基金将利用管理人多年来宏观经济分析上的丰富经验和积累，通过基金管理人自身研发构建固定收益投资决策分析体系（FIFAM 系统）定期评估宏观经济和投资环境，并对全球及国内发展进行评估和展望。在定性或定量分析基础上，判断未来市场发展的主要推动因素，预测关键经济变量。针对宏观经济未来的预期情景，分别预测债券类资产收益和风险并对每类资产未来收益的稳定性进行评估。结合市场情况和预期收益，拟定资产配置方案。</p> <p>本基金将投资于信用品种、可转换债券等品种。对于信用债仓位、评级及期限的选择均是建立在对经济基本面、政策面、资金面以及收益水平和流动性风险的分析的基础上。此外，信用债发行主体差异较大，需要自下而上研究债券发行主体的基本面以确定发债主体企业的实际信用风险，通过比较市场信用利差和个券信用利差以发现被错误定价的个券。本基金将通过在行业 and 个券方面进行分散化投资，同时规避高信用风险行业和主体的前提下，适度提高组合收益并控制投资风险。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债新综合财富（总值）指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 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           | 400-61-95555                |
|             | 电子邮箱 | tkfchenwg06@tkfunds.cn | zhangshan_1027@cmbchina.com |

|        |                                   |                      |
|--------|-----------------------------------|----------------------|
| 客户服务电话 | 4001895522                        | 400-61-95555         |
| 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 11,243,674.91                       |
| 本期利润          | 7,660,473.80                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0113                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.04%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.12%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 56,909,442.76                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0868                              |
| 期末基金资产净值      | 721,216,151.98                      |
| 期末基金份额净值      | 1.0994                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 39.57%                              |

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。

（2）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（3）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。

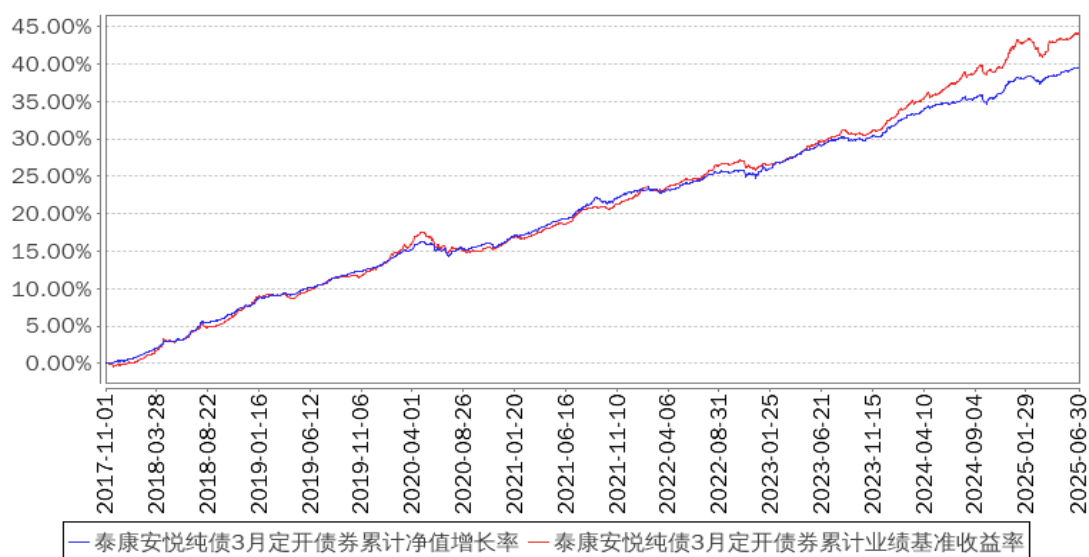
3.2 基金净值表现

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      | 0.34%    | 0.02%       | 0.50%      | 0.03%         | -0.16% | -0.01% |
| 过去三个月      | 1.00%    | 0.04%       | 1.67%      | 0.09%         | -0.67% | -0.05% |
| 过去六个月      | 1.12%    | 0.05%       | 1.05%      | 0.11%         | 0.07%  | -0.06% |
| 过去一年       | 3.49%    | 0.07%       | 4.80%      | 0.10%         | -1.31% | -0.03% |
| 过去三年       | 12.17%   | 0.06%       | 15.57%     | 0.07%         | -3.40% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 39.57%   | 0.05%       | 44.04%     | 0.07%         | -4.47% | -0.02% |

### 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

泰康安悦纯债3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 2017 年 11 月 01 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 2025 年 6 月 30 日，泰康基金共管理 85 只证券投资基金。产品已形成包括货币、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 及养老目标基金等不同类型、不同风险收益特征的产品系列。泰康基金主动与被动业务双轮发展，旗下基金覆盖沪深 300、中证 500、中证 A500 等重要宽基指数，及半导体、智能电车、碳中和、医疗健康、大消费等细分行业，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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 任翀 | 本基金基金经理 | 2017 年 11 月 1 日 | —    | 17 年   | 任翀，硕士研究生。2015 年 7 月加入泰康公募，现任泰康基金固定收益基金经理。曾任安永华明会计师事务所高级审计员、中国银行总行金融市场部投资经理、安信基金固定收益部总经理助理等职务。2016 年 3 月 23 日至今担任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 30 日至今担任泰康安益纯债债券型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 26 日至今担任泰康安惠纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 1 日至今担任泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 27 日至 2023 年 12 月 12 日担任泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金基金经理。2019 年 3 月 14 日至今担任泰康裕泰债券型证券投资基金基金经理。2019 年 5 月 27 日至 2021 年 5 月 7 日担任泰康安业政策性金融债债券型 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 17 日至 2024 年 1 月 12 日担任泰康安欣纯债债券型证券投资基金基金经理。2024 年 2 月 28 日至今担任泰康悦享 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理。2024 年 8 月 1 日至今担任泰康悦享 60 天持有期债券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

宏观经济方面，2025 年上半年延续了此前结构分化的特征，但部分领域的韧性好于预期，宏观经济预期有所改善。结构分化体现在，出口和制造业继续支撑经济，但地产在年初的小阳春之后明显降温。消费在以旧换新的支撑下，表现较好。相对于现实层面的数据，预期的改善更为明显，科技领域突破、出口在关税冲击下仍然保持韧性等，增强了宏观信心。

债券市场方面，上半年总体震荡运行，不同资产之间表现分化。2-3 月风险偏好的提升和资金面的收紧，导致收益率明显调整；但此后对等关税超预期，利率快速下行。5-6 月利率总体在低位震荡。信用债表现好于利率债，利率债内部长端表现好于短端，短端利率受限于年初的估值

水平，整体偏低。

固收投资上，我们在 3 月份之前保持了较低的仓位，3、4 月份在利率脉冲之后进行了加仓，二季度保持了较高的杠杆和久期，主要是因为偏弱的内需和适度宽松的货币政策仍有利于债市。持仓以利率债和高等级二永债为主，适度加仓城投债，辅以长债波段交易，同时严格防范信用风险。

#### 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 1.0994 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.12%; 同期业绩比较基准增长率为 1.05%。

#### 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，“反内卷”政策如何推行，成为最大看点。宏观经济或能继续维持平稳运行的特征，出口存在一定的向下压力、但韧性犹存；财政力度或边际退坡，但如果反内卷政策能提振市场预期、有效平衡部分行业的供需格局，则有利于通缩预期的缓解。外部环境处于缓和期，为国内提供了良好的发展环境。

下半年债券市场或阶段性承压，但趋势性明显调整的概率偏低，总体仍然维持低位震荡的格局。通缩预期如果能缓解，对债券偏不利，但需要看到，走出通缩或将是一个漫长的渐进的过程，需求侧配合的程度也不大，经济的企稳和风险偏好的提升仍然非常依赖于低利率环境。

固收投资上，中长期来看，房地产行业进入下行通道，以及工业产能利用率偏低的局面，将使我国通胀长期保持低位，这是债券牛市的根基。短期来看，在内需承压的大背景下，我们认为中国央行大概率维持资金面适度宽松，债券利率震荡下行的可能性较大。我们将以高等级二永债为底仓，利率债波段操作，力争控制好回撤，并争取为投资者创造绝对收益。

#### 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，并经托管人复核确认。

#### 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，本报告期本基金未进行利润分配。

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

本报告期本基金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合规守信情况声明

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合规守信、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：泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产       | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：      |         |                        |                          |
| 货币资金      | 6.4.7.1 | 854,233.65             | 321,316.61               |
| 结算备付金     |         | 8,773,710.05           | 14,252,869.22            |
| 存出保证金     |         | 425,741.61             | 16,734.87                |
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 917,065,231.02         | 909,368,369.74           |
| 其中：股票投资   |         | -                      | -                        |
| 基金投资      |         | -                      | -                        |
| 债券投资      |         | 917,065,231.02         | 909,368,369.74           |
| 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 | -                      | -                        |
| 其中：债券投资   |         | -                      | -                        |
| 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     |         | -                      | -                        |
| 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      |         | 927,118,916.33         | 923,959,290.44           |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 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 |         | 205,423,616.44         | 9,699,202.07             |
| 应付清算款     |         | 100,384.04             | 21,166.63                |
| 应付赎回款     |         | -                      | -                        |

|          |          |                |                |
|----------|----------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬  |          | 173,887.89     | 231,348.28     |
| 应付托管费    |          | 57,962.64      | 77,116.10      |
| 应付销售服务费  |          | -              | -              |
| 应付投资顾问费  |          | -              | -              |
| 应交税费     |          | 26,275.45      | 29,029.60      |
| 应付利润     |          | -              | -              |
| 递延所得税负债  |          | -              | -              |
| 其他负债     | 6.4.7.9  | 120,637.89     | 116,612.45     |
| 负债合计     |          | 205,902,764.35 | 10,174,475.13  |
| 净资产：     |          |                |                |
| 实收基金     | 6.4.7.10 | 655,993,916.09 | 840,461,262.78 |
| 其他综合收益   | 6.4.7.11 | -              | -              |
| 未分配利润    | 6.4.7.12 | 65,222,235.89  | 73,323,552.53  |
| 净资产合计    |          | 721,216,151.98 | 913,784,815.31 |
| 负债和净资产总计 |          | 927,118,916.33 | 923,959,290.44 |

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0994 元，基金份额总额 655,993,916.09 份。

6.2 利润表

会计主体：泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入           |          | 10,144,734.84                            | 81,210,115.46                                 |
| 1. 利息收入           |          | 58,840.30                                | 111,974.27                                    |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 49,300.15                                | 111,974.27                                    |
| 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        |          | 9,540.15                                 | -                                             |
| 其他利息收入            |          | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 13,669,095.65                            | 85,971,729.59                                 |
| 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 | 13,884,030.40                            | 86,538,356.23                                 |
| 资产支持证券投资          | 6.4.7.16 | -                                        | -                                             |
| 收益                |          | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益           | 6.4.7.17 | -                                        | -                                             |

|                               |            |               |               |
|-------------------------------|------------|---------------|---------------|
| 衍生工具收益                        | 6.4.7.18   | -214,934.75   | -566,626.64   |
| 股利收益                          | 6.4.7.19   | -             | -             |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产生的<br>收益 |            | -             | -             |
| 其他投资收益                        |            | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）    | 6.4.7.20   | -3,583,201.11 | -4,873,588.40 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）        |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）        | 6.4.7.21   | -             | -             |
| 减：二、营业总支出                     |            | 2,484,261.04  | 12,033,884.48 |
| 1. 管理人报酬                      | 6.4.10.2.1 | 1,104,692.50  | 4,123,660.68  |
| 其中：暂估管理人报酬                    |            | -             | -             |
| 2. 托管费                        | 6.4.10.2.2 | 368,230.85    | 1,374,553.56  |
| 3. 销售服务费                      | 6.4.10.2.3 | -             | -             |
| 4. 投资顾问费                      |            | -             | -             |
| 5. 利息支出                       |            | 872,474.15    | 6,350,487.22  |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出             |            | 872,474.15    | 6,350,487.22  |
| 6. 信用减值损失                     | 6.4.7.22   | -             | -             |
| 7. 税金及附加                      |            | 22,687.83     | 48,182.56     |
| 8. 其他费用                       | 6.4.7.23   | 116,175.71    | 137,000.46    |
| 三、利润总额（亏损总额<br>以“-”号填列）       |            | 7,660,473.80  | 69,176,230.98 |
| 减：所得税费用                       |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”<br>号填列）         |            | 7,660,473.80  | 69,176,230.98 |
| 五、其他综合收益的税后<br>净额             |            | -             | -             |
| 六、综合收益总额                      |            | 7,660,473.80  | 69,176,230.98 |

6.3 净资产变动表

会计主体：泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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<br>资产 | 840,461,262.78                        | -      | 73,323,552.53 | 913,784,815.31 |
| 加：会计政策变       | -                                     | -      | -             | -              |



|                                          |                                            |        |                |                  |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|----------------|------------------|
| 更                                        |                                            |        |                |                  |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -              | -                |
| 其他                                       | -                                          | -      | -              | -                |
| 二、本期期初净资产                                | 840,461,262.78                             | -      | 73,323,552.53  | 913,784,815.31   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -184,467,346.69                            | -      | -8,101,316.64  | -192,568,663.33  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 7,660,473.80   | 7,660,473.80     |
| (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)      | -184,467,346.69                            | -      | -15,761,790.44 | -200,229,137.13  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 228,627,426.06                             | -      | 21,965,573.94  | 250,593,000.00   |
| 2. 基金赎回款                                 | -413,094,772.75                            | -      | -37,727,364.38 | -450,822,137.13  |
| (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                                | 655,993,916.09                             | -      | 65,222,235.89  | 721,216,151.98   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |        |                |                  |
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 2,628,265,509.66                           | -      | 94,474,428.44  | 2,722,739,938.10 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -              | -                |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -              | -                |
| 其他                                       | -                                          | -      | -              | -                |

|                                          |                  |   |                |                  |
|------------------------------------------|------------------|---|----------------|------------------|
| 二、本期期初净资产                                | 2,628,265,509.66 | - | 94,474,428.44  | 2,722,739,938.10 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 189.80           | - | 69,176,241.18  | 69,176,430.98    |
| (一)、综合收益总额                               | -                | - | 69,176,230.98  | 69,176,230.98    |
| (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)      | 189.80           | - | 10.20          | 200.00           |
| 其中：1. 基金申购款                              | 189.80           | - | 10.20          | 200.00           |
| 2. 基金赎回款                                 | -                | - | -              | -                |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                | - | -              | -                |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                | - | -              | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 2,628,265,699.46 | - | 163,650,669.62 | 2,791,916,369.08 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>金志刚</u> | <u>金志刚</u> | <u>李俊佑</u> |
| 基金管理人负责人   | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人    |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1580 号《关于准予泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式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

《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、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 309,999,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 947 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 309,999,000.00 份基金份额，未发生认购资金利息折份额。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”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的债券资产(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、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、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、国债期货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。本基金不直接投资股票、权证等权益类资产，但可持有因可转债转股所形成的股票、因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产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，在每次开放期前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；在开放期内每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：中债新综合财富(总值)指数收益率。

#### 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》、《泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 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[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》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人作为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 对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, 暂不缴纳企业所得税。

(3) 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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 854,233.65             |
| 等于：本金          | 854,067.09             |
| 加：应计利息         | 166.56                 |
| 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             | 854,233.65             |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |               |                |              |
|---------------|-------|------------------------|---------------|----------------|--------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息          | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            |       | -                      | -             | -              | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -             | -              | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 154,697,657.45         | 635,489.47    | 156,060,571.67 | 727,424.75   |
|               | 银行间市场 | 744,553,682.09         | 10,405,759.35 | 761,004,659.35 | 6,045,217.91 |
|               | 合计    | 899,251,339.54         | 11,041,248.82 | 917,065,231.02 | 6,772,642.66 |
| 资产支持证券        |       | -                      | -             | -              | -            |
| 基金            |       | -                      | -             | -              | -            |
| 其他            |       | -                      | -             | -              | -            |
| 合计            |       | 899,251,339.54         | 11,041,248.82 | 917,065,231.02 | 6,772,642.66 |

## 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

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |      |    |    |
|---------------|------------------------|------|----|----|
|               | 合同/名义<br>金额            | 公允价值 |    | 备注 |
|               |                        | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具        | -12,083,000.00         | —    | —  |    |
| 其中：<br>国债期货投资 | -12,083,000.00         | —    | —  |    |
| 货币衍生工具        | —                      | —    | —  |    |
| 权益衍生工具        | —                      | —    | —  |    |
| 其他衍生工具        | —                      | —    | —  |    |
| 合计            | -12,083,000.00         | —    | —  |    |

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码         | 名称     | 持仓量（买/卖） | 合约市值           | 公允价值变动    |
|------------|--------|----------|----------------|-----------|
| TL2509     | TL2509 | -10.00   | -12,040,000.00 | 43,000.00 |
| 合计         |        |          |                | 43,000.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 |        |          |                | 43,000.00 |
| 净额         |        |          |                | 0.00      |

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

（2）衍生金融资产项下的权益衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

## 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

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

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>2025 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 31,302.85              |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 31,302.85              |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 89,335.04              |
| 合计          | 120,637.89             |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |                 |
|---------------|---------------------------------|-----------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额            |
| 上年度末          | 840,461,262.78                  | 840,461,262.78  |
| 本期申购          | 228,627,426.06                  | 228,627,426.06  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -413,094,772.75                 | -413,094,772.75 |
| 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           | 655,993,916.09                  | 655,993,916.09  |

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           | 58,796,483.03  | 14,527,069.50 | 73,323,552.53  |
| 加：会计政策变更       | -              | -             | -              |
| 前期差错更正         | -              | -             | -              |
| 其他             | -              | -             | -              |
| 本期期初           | 58,796,483.03  | 14,527,069.50 | 73,323,552.53  |
| 本期利润           | 11,243,674.91  | -3,583,201.11 | 7,660,473.80   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -13,130,715.18 | -2,631,075.26 | -15,761,790.44 |
| 其中：基金申购款       | 19,087,210.28  | 2,878,363.66  | 21,965,573.94  |
| 基金赎回款          | -32,217,925.46 | -5,509,438.92 | -37,727,364.38 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 56,909,442.76  | 8,312,793.13  | 65,222,235.89  |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 3,521.58                        |
| 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 | 38,520.57                       |
| 其他        | 7,258.00                        |
| 合计        | 49,300.15                       |



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

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 12,693,051.80              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,190,978.60               |
| 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                           | 13,884,030.40              |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 935,035,505.74             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 919,036,707.62             |
| 减：应计利息总额               | 14,786,219.19              |
| 减：交易费用                 | 21,600.33                  |
| 买卖债券差价收入               | 1,190,978.60               |

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

单位：人民币元

| 项目       | 本期                              |
|----------|---------------------------------|
|          | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 国债期货投资收益 | -214,934.75                     |

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | -3,626,201.11                   |
| 股票投资       | -                               |
| 债券投资       | -3,626,201.11                   |
| 资产支持证券投资   | -                               |
| 基金投资       | -                               |

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| 贵金属投资                  | -             |
| 其他                     | -             |
| 2. 衍生工具                | 43,000.00     |
| 权证投资                   | -             |
| 期货投资                   | 43,000.00     |
| 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                     | -3,583,201.11 |

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 20,827.67                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行费用    | 17,240.67                             |
| 债券帐户维护费 | 18,000.00                             |
| 其他      | 600.00                                |
| 合计      | 116,175.71                            |

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

截至财务报表报出日，本基金并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>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,104,692.50                          | 4,123,660.68                               |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 2,540.47                              | —                                          |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,102,152.03                          | 4,123,660.68                               |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 368,230.85                            | 1,374,553.56                               |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 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>2025 年 1 月 1 日至 2025 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>2024 年 1 月 1 日至 2024 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                                       | 92,791,800.00 | -    | -     | -    | -     | -    |

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

无。

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

无。

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>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |          |
|-------|---------------------------------------|----------|--------------------------------------------|----------|
|       | 期末余额                                  | 当期利息收入   | 期末余额                                       | 当期利息收入   |
| 招商银行  | 854,233.65                            | 3,521.58 | 317,546.73                                 | 6,118.82 |

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

无。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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 2025 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 202,023,616.44 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        |
|-----------|--------------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 2028033   | 20 建设银行<br>二级      | 2025 年 7 月 1 日 | 103.84 | 500,000 | 51,919,794.52 |
| 2128052   | 21 工商银行<br>二级 03   | 2025 年 7 月 1 日 | 112.37 | 85,000  | 9,551,709.89  |
| 2228042   | 22 农业银行<br>二级 02   | 2025 年 7 月 1 日 | 110.50 | 109,000 | 12,044,500.00 |
| 232380017 | 23 光大二级<br>资本债 01A | 2025 年 7 月 1 日 | 105.36 | 100,000 | 10,536,246.58 |
| 232480011 | 24 农行二级<br>资本债 02A | 2025 年 7 月 1 日 | 102.02 | 100,000 | 10,202,069.04 |
| 232480020 | 24 兴业银行            | 2025 年 7 月 1 日 | 102.41 | 73,000  | 7,475,870.00  |

|           |                          |                   |        |           |                |
|-----------|--------------------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
|           | 二级资本债<br>01              | 日                 |        |           |                |
| 232580006 | 25 民生银行<br>二级资本债<br>01   | 2025 年 7 月 1<br>日 | 100.86 | 235,000   | 23,700,947.53  |
| 272380011 | 23 人寿再保<br>险资本补充<br>债 01 | 2025 年 7 月 1<br>日 | 106.52 | 500,000   | 53,261,654.79  |
| 272380013 | 23 建信人寿<br>资本补充债<br>01   | 2025 年 7 月 1<br>日 | 107.28 | 200,000   | 21,455,063.01  |
| 272400007 | 24 中国人寿<br>资本补充债<br>01BC | 2025 年 7 月 1<br>日 | 102.22 | 200,000   | 20,444,005.48  |
| 合计        |                          |                   |        | 2,102,000 | 220,591,860.84 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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 3,400,000.00 元,于 2025 年 7 月 1 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。

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>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 20,465,879.45          | 20,143,917.81            |
| A-1 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 25,085,760.82          | 40,682,916.17            |
| 合计     | 45,551,640.27          | 60,826,833.98            |

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>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 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>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 660,911,107.06         | 496,071,467.36           |
| AAA 以下 | 30,256,946.69          | 71,343,853.33            |
| 未评级    | 180,345,537.00         | 216,673,609.59           |
| 合计     | 871,513,590.75         | 784,088,930.28           |

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>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 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 | 上年度末 |
|--------|-----|------|
|--------|-----|------|

|        | 2025 年 6 月 30 日 | 2024 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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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 2025 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 2025 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 2025 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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 1 年以内          | 1-5 年          | 5 年以上          | 不计息        | 合计             |
|------------------------|----------------|----------------|----------------|------------|----------------|
| 资产                     |                |                |                |            |                |
| 货币资金                   | 854,233.65     | -              | -              | -          | 854,233.65     |
| 结算备付金                  | 8,773,710.05   | -              | -              | -          | 8,773,710.05   |
| 存出保证金                  | 425,741.61     | -              | -              | -          | 425,741.61     |
| 交易性金融资产                | 94,584,886.85  | 392,475,276.66 | 430,005,067.51 | -          | 917,065,231.02 |
| 资产总计                   | 104,638,572.16 | 392,475,276.66 | 430,005,067.51 | -          | 927,118,916.33 |
| 负债                     |                |                |                |            |                |
| 应付管理人报酬                | -              | -              | -              | 173,887.89 | 173,887.89     |
| 应付托管费                  | -              | -              | -              | 57,962.64  | 57,962.64      |

|                          |                 |                |                |             |                |
|--------------------------|-----------------|----------------|----------------|-------------|----------------|
| 应付清算款                    | -               | -              | -              | 100,384.04  | 100,384.04     |
| 卖出回购金融资产款                | 205,423,616.44  | -              | -              | -           | 205,423,616.44 |
| 应交税费                     | -               | -              | -              | 26,275.45   | 26,275.45      |
| 其他负债                     | -               | -              | -              | 120,637.89  | 120,637.89     |
| 负债总计                     | 205,423,616.44  | -              | -              | 479,147.91  | 205,902,764.35 |
| 利率敏感度缺口                  | -100,785,044.28 | 392,475,276.66 | 430,005,067.51 | -479,147.91 | 721,216,151.98 |
| 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 | 1 年以内           | 1-5 年          | 5 年以上          | 不计息         | 合计             |
| 资产                       |                 |                |                |             |                |
| 货币资金                     | 321,316.61      | -              | -              | -           | 321,316.61     |
| 结算备付金                    | 14,252,869.22   | -              | -              | -           | 14,252,869.22  |
| 存出保证金                    | 16,734.87       | -              | -              | -           | 16,734.87      |
| 交易性金融资产                  | 109,064,595.20  | 491,135,308.82 | 309,168,465.72 | -           | 909,368,369.74 |
| 资产总计                     | 123,655,515.90  | 491,135,308.82 | 309,168,465.72 | -           | 923,959,290.44 |
| 负债                       |                 |                |                |             |                |
| 应付管理人报酬                  | -               | -              | -              | 231,348.28  | 231,348.28     |
| 应付托管费                    | -               | -              | -              | 77,116.10   | 77,116.10      |
| 应付清算款                    | -               | -              | -              | 21,166.63   | 21,166.63      |
| 卖出回购金融资产款                | 9,699,202.07    | -              | -              | -           | 9,699,202.07   |
| 应交税费                     | -               | -              | -              | 29,029.60   | 29,029.60      |
| 其他负债                     | -               | -              | -              | 116,612.45  | 116,612.45     |
| 负债总计                     | 9,699,202.07    | -              | -              | 475,273.06  | 10,174,475.13  |
| 利率敏感度缺口                  | 113,956,313.83  | 491,135,308.82 | 309,168,465.72 | -475,273.06 | 913,784,815.31 |

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的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（2025 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率上调 0.25%                                             | -5,300,640.34               | -6,038,205.26          |
|    | 市场利率下调 0.25%                                             | 5,362,532.14                | 6,110,835.24           |

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

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 10,075,466.84          | 20,900,883.74            |
| 第二层次          | 906,989,764.18         | 888,467,486.00           |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 917,065,231.02         | 909,368,369.74           |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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，确定相关债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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            | 917,065,231.02 | 98.92         |
|    | 其中：债券             | 917,065,231.02 | 98.92         |
|    | 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      | 9,627,943.70   | 1.04          |
| 8  | 其他各项资产            | 425,741.61     | 0.05          |
| 9  | 合计                | 927,118,916.33 | 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      | 563,303,398.78 | 78.10        |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 145,985,104.83 | 20.24        |
| 5  | 企业短期融资券   | 45,551,640.27  | 6.32         |
| 6  | 中期票据      | 152,149,620.30 | 21.10        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 10,075,466.84  | 1.40         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 917,065,231.02 | 127.16       |

## 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  | 272380011 | 23 人寿再保险<br>资本补充债 01  | 500,000 | 53,261,654.79 | 7.38         |
| 2  | 272400007 | 24 中国人寿资<br>本补充债 01BC | 520,000 | 53,154,414.25 | 7.37         |
| 3  | 2028033   | 20 建设银行二<br>级         | 500,000 | 51,919,794.52 | 7.20         |
| 4  | 2028041   | 20 工商银行二<br>级 01      | 450,000 | 46,708,890.41 | 6.48         |
| 5  | 2028025   | 20 浦发银行二<br>级 01      | 450,000 | 46,667,739.45 | 6.47         |

## 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

根据风险管理原则，本基金以套期保值为主要目的进行国债期货投资。通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现券资产进行匹配，



采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.10.2 本期国债期货投资评价

在进行了全面而深入的定性与定量分析后，本基金本报告期国债期货套期保值操作较好地对冲了利率风险、流动性风险对基金的影响，降低了基金净值的波动，取得了预期的对冲效果。

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

中国工商银行股份有限公司其私人银行部因未依法履行相关职责在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局上海监管局的公开处罚。

中国人寿保险股份有限公司因未依法履行相关职责、公司运作、治理违规在本报告编制前一年内受到中国人民银行的公开处罚。

中国建设银行股份有限公司因未依法履行相关职责在本报告编制前一年内受到中国人民银行的公开处罚。

中国民生银行股份有限公司因未依法履行相关职责在本报告编制前一年内受到中国人民银行的公开处罚、公开批评。

中国农业银行股份有限公司因未依法履行相关职责、公司运作、治理违规在本报告编制前一年内受到中国人民银行的公开处罚、公开批评；其信用卡中心因未依法履行职责在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局上海监管局的公开处罚。

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

本基金本报告期内未持有股票。

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 | 425,741.61 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 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    | 425,741.61 |

#### 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  | 111017 | 蓝天转债    | 1,088,260.66 | 0.15         |
| 2  | 113647 | 禾丰转债    | 918,881.10   | 0.13         |
| 3  | 113638 | 台 21 转债 | 770,890.80   | 0.11         |
| 4  | 123130 | 设研转债    | 718,156.44   | 0.10         |
| 5  | 123090 | 三诺转债    | 713,088.30   | 0.10         |
| 6  | 111010 | 立昂转债    | 577,459.59   | 0.08         |
| 7  | 127088 | 赫达转债    | 573,249.59   | 0.08         |
| 8  | 123133 | 佩蒂转债    | 499,951.78   | 0.07         |
| 9  | 113692 | 保隆转债    | 383,259.78   | 0.05         |
| 10 | 127049 | 希望转 2   | 237,833.11   | 0.03         |
| 11 | 128124 | 科华转债    | 229,026.21   | 0.03         |
| 12 | 113058 | 友发转债    | 225,678.64   | 0.03         |
| 13 | 127071 | 天箭转债    | 215,651.45   | 0.03         |
| 14 | 123158 | 宙邦转债    | 213,323.80   | 0.03         |
| 15 | 123236 | 家联转债    | 163,123.59   | 0.02         |
| 16 | 111002 | 特纸转债    | 147,742.47   | 0.02         |
| 17 | 113046 | 金田转债    | 142,160.58   | 0.02         |
| 18 | 123114 | 三角转债    | 91,244.03    | 0.01         |
| 19 | 110089 | 兴发转债    | 88,515.74    | 0.01         |
| 20 | 113672 | 福蓉转债    | 80,670.82    | 0.01         |
| 21 | 123216 | 科顺转债    | 76,325.06    | 0.01         |
| 22 | 123124 | 晶瑞转 2   | 72,477.24    | 0.01         |
| 23 | 110090 | 爱迪转债    | 66,120.62    | 0.01         |
| 24 | 123071 | 天能转债    | 52,485.97    | 0.01         |
| 25 | 123212 | 立中转债    | 44,431.74    | 0.01         |
| 26 | 113039 | 嘉泽转债    | 35,579.78    | 0.00         |
| 27 | 127045 | 牧原转债    | 14,561.88    | 0.00         |
| 28 | 118014 | 高测转债    | 3,749.41     | 0.00         |
| 29 | 128129 | 青农转债    | 1,171.97     | 0.00         |

#### 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           | 占总份额比例<br>(%) | 持有份额  | 占总份额比例<br>(%) |
| 208          | 3,153,816.90  | 655,993,916.09 | 100.00        | 0.00  | 0.00          |

### 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                  |

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有 10,000,000 份为发起份额,发起份额承诺的持有期限为 2017 年 11 月 1 日至 2020 年 10 月 31 日。截至本报告期末,发起资金持有份额为 0 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017 年 11 月 1 日）<br>基金份额总额 | 309,999,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 840,461,262.78 |
| 本报告期基金总申购份额                        | 228,627,426.06 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 413,094,772.75 |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 655,993,916.09 |

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

本基金管理人于 2025 年 5 月 30 日发布公告，自 2025 年 5 月 29 日起，蒋利娟担任公司副总经理，代胜伟担任公司副总经理、财务负责人，金志刚不再兼任公司财务负责人，同时，由金志刚兼任公司首席信息官，朱伟不再担任公司首席信息官。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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

自 2025 年 1 月 17 日起, 本基金改聘审计服务机构, 由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙), 该变更事项已履行相关程序。

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(%) |    |
| 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         | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券         | 4 | - | - | - | - | - |
| 广发证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 国海证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联民生<br>证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券         | 3 | - | - | - | - | - |
| 国泰海通<br>证券   | 4 | - | - | - | - | - |
| 国投证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 华安证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 西南证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 野村东方<br>国际证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司         | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券         | 3 | - | - | - | - | - |
| 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

租用协议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：

- （一）合规风控能力较强，经营行为规范，近一年内无重大违规行为及风险事件，未受监管机构重大处罚
- （二）财务状况和经营状况良好；
- （三）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；
- （四）有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据公司各类资产管理产品（以下简称“产品”）投资需求提供专门的研究报告；
- （五）能及时提供准确的信息资讯服务；
- （六）满足产品运作的保密要求；
- （七）有较强的交易能力；
- （八）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、服务质量、交易服务进行评估，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、本报告期内本基金减少租用 2 个交易单元，东亚前海证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个；新增租用 1 个交易单元，国盛证券北京证券交易所交易单元 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 (%) |
| 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<br>券   | 66,739,865.<br>37 | 100.00 | 235,900,000.<br>00 | 100.00 | - | - |
| 方正证<br>券   | -                 | -      | -                  | -      | - | - |
| 光大证<br>券   | -                 | -      | -                  | -      | - | - |
| 广发证<br>券   | -                 | -      | -                  | -      | - | - |
| 国海证<br>券   | -                 | -      | -                  | -      | - | - |
| 国金证<br>券   | -                 | -      | -                  | -      | - | - |
| 国联民<br>生证券 | -                 | -      | -                  | -      | - | - |
| 国盛证<br>券   | -                 | -      | -                  | -      | - | - |
| 国泰海<br>通证券 | -                 | -      | -                  | -      | - | - |
| 国投证<br>券   | -                 | -      | -                  | -      | - | - |
| 国信证<br>券   | -                 | -      | -                  | -      | - | - |
| 华安证<br>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   | -                 | -      | -                  | -      | - | - |

|                  |   |   |   |   |   |   |
|------------------|---|---|---|---|---|---|
| 西南证<br>券         | - | - | - | - | - | - |
| 信达证<br>券         | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证<br>券         | - | - | - | - | - | - |
| 野村东<br>方国际<br>证券 | - | - | - | - | - | - |
| 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         | - | - | - | - | - | - |
| 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  | 泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告（1）           | 《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 | 2025 年 1 月 18 日 |
| 2  | 泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告（2）           | 《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 | 2025 年 1 月 18 日 |
| 3  | 泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年第四季度报告  | 《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 | 2025 年 1 月 21 日 |
| 4  | 泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务公告 | 《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 | 2025 年 2 月 13 日 |
| 5  | 泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 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 | 2025 年 3 月 28 日 |
| 6  | 泰康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         | 《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 | 2025 年 3 月 29 日 |
| 7  | 泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型                        | 《上海证券报》；中国证                   | 2025 年 4 月 21 日 |

|   |                                           |                               |                 |
|---|-------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|
|   | 发起式证券投资基金 2025 年第一季度报告                    | 监会基金电子披露网站及基金管理人网站            |                 |
| 8 | 泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务公告 | 《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 | 2025 年 5 月 29 日 |
| 9 | 泰康基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                   | 《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 | 2025 年 5 月 30 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              | 20250101-20250630       | 523,846,338.15 | 0.00          | 367,000,000.00 | 156,846,338.15 | 23.91   |
|                                                                                                                                           | 2              | 20250101-20250630       | 172,203,088.44 | 92,708,276.30 | 0.00           | 264,911,364.74 | 40.38   |
| 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安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件；
- (二)《泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- (三)《泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (四)《泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- (五)《泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式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

2025 年 8 月 28 日