

泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型  
证券投资基金  
2025 年第 2 季度报告

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

报告送出日期：2025 年 7 月 18 日

§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。

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 7 月 17 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 2025 年 4 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 泰康金泰 3 月定开混合                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金主代码      | 003813                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金运作方式     | 契约型定期开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基金合同生效日    | 2017 年 1 月 22 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 报告期末基金份额总额 | 36,986,328.71 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 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，在合理控制风险的基础上，追求超越业绩比较基准的收益水平。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 投资策略       | <p>本基金将充分发挥基金管理人在大类资产配置上的投资研究优势，综合运用定量分析和定性分析手段，全面评估证券市场当期的投资环境，并对可以预见的未来时期内各大类资产的风险收益状况进行分析与预测。在此基础上，制定本基金在权益类资产与固定收益类资产上的战略配置比例，并定期或不定期地进行调整。</p> <p>股票投资方面，在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与权益类资产的投资，以增加基金收益。本基金在股票基本面研究的基础上，同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，将影响上市公司基本面和股价的增长类因素、估值类因素、盈利类因素、财务风险等因素进行综合分析，精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的上市公司股票进行投资，以此构建股票组合。</p> <p>债券投资方面，本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期和期限结构配置。信用债投资方面，本基金将利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估，重点分析发债主体的行业发展前景、市场地位、公司治理、财务质量、融资目的等要素，分析违约风险以及合理信用利差水平，</p> |

|        |                                            |
|--------|--------------------------------------------|
|        | 识别投资价值。                                    |
| 业绩比较基准 | 15%*沪深 300 指数收益率+85%*中债新综合财富（总值）指数收益率      |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。 |
| 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                                 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2025 年 4 月 1 日-2025 年 6 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 631,125.27                          |
| 2. 本期利润         | 555,334.50                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0150                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 52,280,062.17                       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.4135                              |

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）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

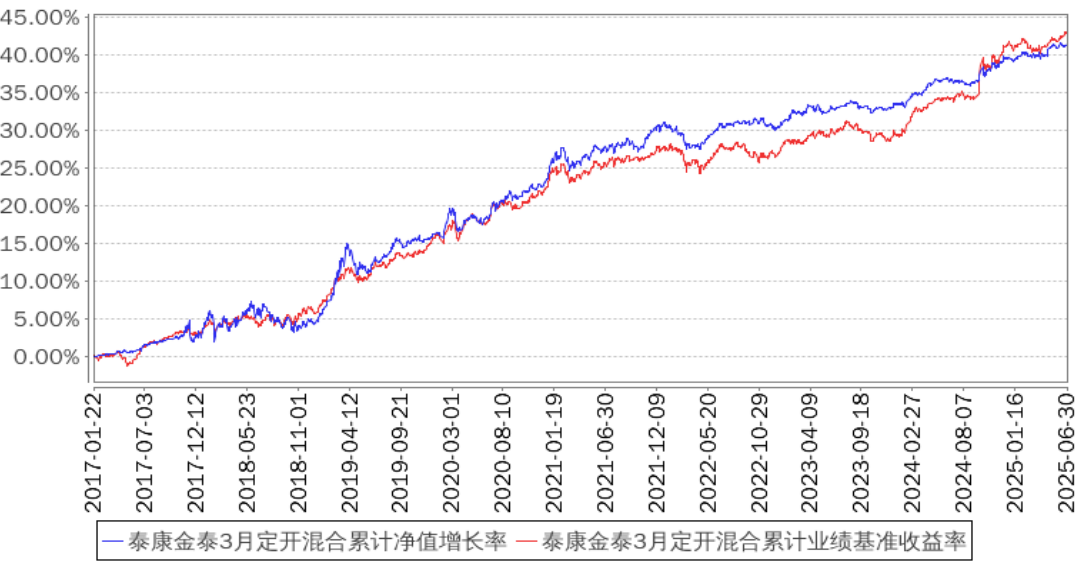
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 1.11%      | 0.14%         | 1.66%          | 0.13%                 | -0.55% | 0.01%  |
| 过去六个月          | 1.24%      | 0.13%         | 0.98%          | 0.14%                 | 0.26%  | -0.01% |
| 过去一年           | 3.38%      | 0.13%         | 6.42%          | 0.19%                 | -3.04% | -0.06% |
| 过去三年           | 8.04%      | 0.11%         | 11.56%         | 0.16%                 | -3.52% | -0.05% |
| 过去五年           | 19.13%     | 0.15%         | 20.75%         | 0.17%                 | -1.62% | -0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 41.35%     | 0.21%         | 42.91%         | 0.17%                 | -1.56% | 0.04%  |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

泰康金泰3月定开混合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 01 月 22 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                      | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|-----|-------------------------|-----------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                         | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 蒋利娟 | 本基金基金经理、固定收益投资部负责人、副总经理 | 2017 年 1 月 22 日 | -    | 17 年   | 蒋利娟，硕士研究生。2008 年 7 月加入泰康资产，历任集中交易室交易员、固定收益部固定收益投资经理。2014 年 11 月加入泰康公募，担任固定收益基金经理、公募事业部固定收益投资负责人。现任泰康基金副总经理、固定收益投资部负责人、固定收益基金经理。2015 年 6 月 19 日至今担任泰康薪意保货币市场基金基金经理。2015 年 9 月 23 日至 2020 年 1 月 6 日担任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 8 日至 2016 年 12 月 27 日担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经 |

|    |         |                  |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|----|---------|------------------|---|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |         |                  |   |      | 理。2016 年 2 月 3 日至今担任泰康稳健增利债券型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月 8 日至今担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 1 月 22 日至今担任泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 15 日至今担任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017 年 8 月 30 日至 2019 年 5 月 9 日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。2017 年 9 月 8 日至 2020 年 3 月 26 日担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。2018 年 5 月 30 日至今担任泰康颐年混合型证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 13 日至 2023 年 6 月 9 日担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 24 日至 2020 年 1 月 14 日担任泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 25 日至 2021 年 1 月 11 日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 5 月 20 日至今担任泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 7 日至今担任泰康合润混合型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 2 日至今担任泰康浩泽混合型证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 31 日至今担任泰康稳健双利债券型证券投资基金基金经理。 |
| 陈怡 | 本基金基金经理 | 2017 年 10 月 13 日 | - | 13 年 | 陈怡，硕士研究生。2016 年 5 月加入泰康公募，现任泰康基金股票基金经理。曾任万家基金管理有限公司研究部研究员，平安养老保险股份有限公司权益投资部研究员、行业投资经理等职务。2017 年 4 月 19 日至 2025 年 1 月 8 日担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2017 年 4 月 19 日至 2019 年 5 月 8 日担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 10 月 13 日至今担任泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 9 日至 2023 年 7 月 25 日担任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 28 日至今担任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 1 月 19                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                           |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 日至 2019 年 5 月 8 日担任泰康均衡优选混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 23 日至今担任泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 3 月 22 日至 2021 年 12 月 7 日担任泰康裕泰债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至 2023 年 7 月 25 日担任泰康申润一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 2 日至今担任泰康浩泽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 公平交易专项说明

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，没有出现本基金管理人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 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，二季度处于宏观指标尚可、微观预期有所波动的阶段。由于抢出口的影响，以及财政节奏总体前倾，宏观数据表现出一定韧性，不足之处在于物价指标仍然维持低位。相比宏观，微观预期的变动较大，特朗普关税及其后续的谈判给市场带来明显扰动。从 5-6 月份开始，地产的微观指标也有所走弱。

固收市场方面，4 月初受超预期关税因素影响，债市快速反应，收益率有所下行。随后，由于债市的利多、利空因素均存在，市场一致预期较浓，普遍认为基本面因素导致收益率可能仍有下行空间。但短期而言，相比政策利率，债市收益率水平已经处于偏低水平，因此 4 月 10 日后债市基本上处于震荡格局。

固收投资方面，适度参与波段交易，根据波段情况调整久期。

权益市场方面，二季度 A 股以“指数温和、结构分化”为核心特征。回顾二季度，4 月上旬特朗普关税政策引发市场避险情绪，4 月中旬以来市场因“日内瓦共识”（暂停 90%关税）反弹，从行业表现上看，金融、通信、军工等涨幅居前，食品饮料、家用电器、钢铁等跌幅较大。宏观经济仍处于弱复苏的阶段，受到内外部环境的制约，以及经济结构转型本身的复杂性和长期性的影响，基本面反弹的斜率和速度低于基金经理的预期。

权益投资方面，本基金的权益部分在一季度的基础上进一步减持了周期和科技的持仓，更加聚焦于消费和先进制造板块。从长期而言，我们认为中国作为一个人口众多、语言较为单一的大市场，仍然是消费品品牌生长的优渥土壤；另一方面，尽管受关税政策、人口红利消退等不利影响，中国供应链优势和企业精神在全球依然是稀缺的供给要素。我们相信聚焦这两大板块，长期而言能够为投资者创造复利。展望后续，我们预计总量经济仍在磨底慢复苏，对权益市场谨慎乐观，但仓位会相对积极，关注消费行业的新供给和制造业出海、智能升级的机会。

4.5 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 1.4135 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.11%；同期业绩比较基准增长率为 1.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内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者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 3,007,739.00  | 5.74         |
|    | 其中：股票  | 3,007,739.00  | 5.74         |
| 2  | 基金投资   | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 41,405,338.86 | 78.99        |
|    | 其中：债券  | 41,405,338.86 | 78.99        |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
|   | 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          | 6,000,000.00  | 11.45  |
|   | 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      | 2,003,913.50  | 3.82   |
| 8 | 其他资产              | 1,770.23      | 0.00   |
| 9 | 合计                | 52,418,761.59 | 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。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | 419,336.00   | 0.80         |
| C  | 制造业              | 2,204,602.00 | 4.22         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -            | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 383,801.00   | 0.73         |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| K  | 房地产业             | -            | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -            | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -            |
| P  | 教育               | -            | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -            | -            |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 3,007,739.00 | 5.75         |

### 5.2.2 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

## 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1  | 002311 | 海大集团 | 9,500  | 556,605.00 | 1.06         |
| 2  | 300866 | 安克创新 | 4,630  | 525,968.00 | 1.01         |
| 3  | 002128 | 电投能源 | 21,200 | 419,336.00 | 0.80         |
| 4  | 002624 | 完美世界 | 25,300 | 383,801.00 | 0.73         |
| 5  | 002003 | 伟星股份 | 28,300 | 308,753.00 | 0.59         |
| 6  | 002594 | 比亚迪  | 900    | 298,719.00 | 0.57         |
| 7  | 603193 | 润本股份 | 8,500  | 266,985.00 | 0.51         |
| 8  | 603337 | 杰克股份 | 6,900  | 247,572.00 | 0.47         |

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 5,379,422.55  | 10.29        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 22,226,249.64 | 42.51        |
|    | 其中：政策性金融债 | 9,709,200.00  | 18.57        |
| 4  | 企业债券      | 2,037,048.77  | 3.90         |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | 7,166,493.92  | 13.71        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 4,596,123.98  | 8.79         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 41,405,338.86 | 79.20        |

## 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称                | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 190210    | 19 国开 10            | 90,000 | 9,709,200.00 | 18.57        |
| 2  | 230012    | 23 付息国债 12          | 50,000 | 5,379,422.55 | 10.29        |
| 3  | 2128025   | 21 建设银行二级 01        | 40,000 | 4,197,501.37 | 8.03         |
| 4  | 2128042   | 21 兴业银行二级 02        | 40,000 | 4,188,386.63 | 8.01         |
| 5  | 232480061 | 24 工行二级资本 债 01A(BC) | 40,000 | 4,131,161.64 | 7.90         |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资  
明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本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

国家开发银行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北京监管局的公开处罚。

兴业银行股份有限公司因公司运作、治理违规在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局福建监管局的公开处罚。

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。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 1,770.23 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 其他      | -        |
| 8  | 合计      | 1,770.23 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | 113059 | 福莱转债    | 232,457.03 | 0.44         |
| 2  | 118034 | 晶能转债    | 209,422.86 | 0.40         |
| 3  | 113045 | 环旭转债    | 178,088.61 | 0.34         |
| 4  | 113685 | 升 24 转债 | 144,541.69 | 0.28         |
| 5  | 111002 | 特纸转债    | 135,923.07 | 0.26         |
| 6  | 128141 | 旺能转债    | 133,893.06 | 0.26         |
| 7  | 110085 | 通 22 转债 | 128,600.59 | 0.25         |
| 8  | 113675 | 新 23 转债 | 122,953.12 | 0.24         |
| 9  | 123158 | 宙邦转债    | 119,461.33 | 0.23         |
| 10 | 123192 | 科思转债    | 119,073.09 | 0.23         |
| 11 | 113065 | 齐鲁转债    | 112,698.97 | 0.22         |
| 12 | 127072 | 博实转债    | 112,138.39 | 0.21         |
| 13 | 110084 | 贵燃转债    | 110,585.39 | 0.21         |
| 14 | 113632 | 鹤 21 转债 | 108,683.02 | 0.21         |
| 15 | 110059 | 浦发转债    | 95,834.71  | 0.18         |
| 16 | 113052 | 兴业转债    | 93,368.63  | 0.18         |
| 17 | 127030 | 盛虹转债    | 87,342.77  | 0.17         |
| 18 | 127090 | 兴瑞转债    | 86,249.38  | 0.16         |
| 19 | 127039 | 北港转债    | 85,943.81  | 0.16         |
| 20 | 110087 | 天业转债    | 81,079.73  | 0.16         |

|    |        |         |           |      |
|----|--------|---------|-----------|------|
| 21 | 113631 | 皖天转债    | 77,743.56 | 0.15 |
| 22 | 110081 | 闻泰转债    | 75,929.64 | 0.15 |
| 23 | 127026 | 超声转债    | 75,773.45 | 0.14 |
| 24 | 118040 | 宏微转债    | 74,199.57 | 0.14 |
| 25 | 110090 | 爱迪转债    | 71,110.86 | 0.14 |
| 26 | 118037 | 上声转债    | 70,443.18 | 0.13 |
| 27 | 123194 | 百洋转债    | 69,612.16 | 0.13 |
| 28 | 128121 | 宏川转债    | 61,323.28 | 0.12 |
| 29 | 123197 | 光力转债    | 59,241.01 | 0.11 |
| 30 | 127027 | 能化转债    | 57,570.44 | 0.11 |
| 31 | 113641 | 华友转债    | 55,399.32 | 0.11 |
| 32 | 118024 | 冠宇转债    | 55,103.01 | 0.11 |
| 33 | 123240 | 楚天转债    | 54,807.97 | 0.10 |
| 34 | 123107 | 温氏转债    | 52,916.17 | 0.10 |
| 35 | 123090 | 三诺转债    | 52,864.87 | 0.10 |
| 36 | 113062 | 常银转债    | 52,719.19 | 0.10 |
| 37 | 111010 | 立昂转债    | 50,816.44 | 0.10 |
| 38 | 113067 | 燃 23 转债 | 45,948.54 | 0.09 |
| 39 | 127031 | 洋丰转债    | 45,534.12 | 0.09 |
| 40 | 128133 | 奇正转债    | 41,332.02 | 0.08 |
| 41 | 113658 | 密卫转债    | 36,924.37 | 0.07 |
| 42 | 123117 | 健帆转债    | 36,550.90 | 0.07 |
| 43 | 113655 | 欧 22 转债 | 36,075.72 | 0.07 |
| 44 | 127050 | 麒麟转债    | 32,188.71 | 0.06 |
| 45 | 113050 | 南银转债    | 31,833.92 | 0.06 |
| 46 | 113686 | 泰瑞转债    | 31,713.44 | 0.06 |
| 47 | 110076 | 华海转债    | 31,312.11 | 0.06 |
| 48 | 127085 | 韵达转债    | 30,743.03 | 0.06 |
| 49 | 128137 | 洁美转债    | 29,398.30 | 0.06 |
| 50 | 128135 | 洽洽转债    | 29,068.02 | 0.06 |
| 51 | 127019 | 国城转债    | 28,406.10 | 0.05 |
| 52 | 127096 | 泰坦转债    | 28,354.05 | 0.05 |
| 53 | 123121 | 帝尔转债    | 28,079.53 | 0.05 |
| 54 | 123176 | 精测转 2   | 26,902.92 | 0.05 |
| 55 | 113053 | 隆 22 转债 | 26,489.22 | 0.05 |
| 56 | 113056 | 重银转债    | 25,190.52 | 0.05 |
| 57 | 123224 | 宇邦转债    | 25,099.97 | 0.05 |
| 58 | 113054 | 绿动转债    | 24,925.79 | 0.05 |
| 59 | 123119 | 康泰转 2   | 23,294.75 | 0.04 |
| 60 | 113037 | 紫银转债    | 21,675.88 | 0.04 |
| 61 | 118033 | 华特转债    | 21,132.64 | 0.04 |
| 62 | 113051 | 节能转债    | 20,535.91 | 0.04 |

|    |        |         |           |      |
|----|--------|---------|-----------|------|
| 63 | 128130 | 景兴转债    | 20,367.89 | 0.04 |
| 64 | 123151 | 康医转债    | 20,341.80 | 0.04 |
| 65 | 123180 | 浙矿转债    | 18,265.58 | 0.03 |
| 66 | 113569 | 科达转债    | 16,704.95 | 0.03 |
| 67 | 123195 | 蓝晓转 02  | 16,170.81 | 0.03 |
| 68 | 113661 | 福 22 转债 | 15,756.49 | 0.03 |
| 69 | 113639 | 华正转债    | 15,488.13 | 0.03 |
| 70 | 113666 | 爱玛转债    | 14,870.47 | 0.03 |
| 71 | 118041 | 星球转债    | 13,080.37 | 0.03 |
| 72 | 123217 | 富仕转债    | 12,998.67 | 0.02 |
| 73 | 127040 | 国泰转债    | 11,800.03 | 0.02 |
| 74 | 127088 | 赫达转债    | 11,627.78 | 0.02 |
| 75 | 113046 | 金田转债    | 9,098.28  | 0.02 |
| 76 | 118035 | 国力转债    | 8,961.52  | 0.02 |
| 77 | 110089 | 兴发转债    | 8,152.77  | 0.02 |
| 78 | 127045 | 牧原转债    | 1,213.49  | 0.00 |
| 79 | 113673 | 岱美转债    | 1,185.81  | 0.00 |

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 37,301,536.38 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,981,177.02  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 2,296,384.69  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 36,986,328.71 |

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

本基金报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金注册的文件；
- （二）《泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- （三）《泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金招募说明书》；
- （四）《泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- （五）《泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金产品资料概要》。

### 9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《证券日报》）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 7 月 18 日