

泰康金泰回报 3 个月持有期混合型
证券投资基金
2026 年第 2 季度报告

2026 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：2026 年 7 月 20 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约定，于 2026 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 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰康金泰回报 3 个月持有
基金主代码	003813
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 12 月 17 日
报告期末基金份额总额	142,957,658.46 份
投资目标	本基金通过合理配置大类资产和精选投资标的，力争在控制风险的基础上，追求超越业绩比较基准的收益水平。
投资策略	1、大类资产配置策略 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。 2、股票投资策略 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、估值合理的国内 A 股及内地与香港股票市场交易互联互通机制下的港股投资标的股票

	进行投资，以此构建股票组合。 3、存托凭证投资策略 本基金可投资存托凭证，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，选择投资价值高的存托凭证进行投资。 4、港股通标的股票投资策略 本基金在以固定收益资产投资为主的基础上，适度参与港股通标的股票投资，以增强整体收益。在港股通投资标的的筛选上，注重对基本面良好、相对 A 股市场估值合理、具备优质成长性、注重现金分红的股票进行长期投资。股票筛选的方法上，将以基本面研究为基础，辅以量化分析，以更深入、更全面的挖掘优质标的。 5、债券投资策略 (1) 久期管理策略 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。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。本基金还通过市场上不同期限品种交易量的变化来分析市场在期限上的投资偏好，并结合对利率走势的判断选择合适久期的债券品种进行投资。 (2) 期限结构配置策略 在确定组合久期的基础上，运用统计和数量分析技术、对市场利率期限结构历史数据进行分析检验和情景测试，并综合考虑债券市场微观因素如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等，形成对债券收益率曲线形态及其发展趋势的判断，从而在子弹型、杠铃型或阶梯型配置策略中进行选择并动态调整。 (3) 骑乘策略 通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，当债券收益率曲线比较陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，这样可同时获得该债券持有期的稳定的票息收入以及收益率下降带来的价差收入；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。 (4) 息差策略 根据市场利率水平，收益率曲线的形态以及对利率期限结构的预期，通过采用长期债券和短期回购相结合，获取债券票息收益和回购利率成本之间的利
--	---

	差。当回购利率低于债券收益率时，可以将正回购所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债基投资的收益。 （5）信用策略 发债主体的资信状况以及信用利差曲线的变动将直接决定信用债的收益率水平。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，分析违约风险以及合理信用利差水平，识别投资价值。本基金所投资信用债的信用评级机构外部评级需在 AA 以上（含 AA），此处信用评级机构为取得中国证监会证券评级业务许可的资信评级机构，且不包括国外评级机构和中债资信评估有限责任公司。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，分析违约风险以及合理信用利差水平，识别投资价值。其中，本基金投资于信用评级为 AAA 的信用债占信用债资产的比例不低于 50%，投资于信用评级为 AA+ 的信用债占信用债资产的比例不高于 50%，投资于信用评级为 AA 的信用债占信用债资产的比例不高于 20%。如因证券市场波动、基金规模变动、评级变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述要求的，基金管理人应当在 3 个月内进行调整。 （6）个券精选策略 根据发行人公司所在行业发展以及公司治理、财务状况等信息对债券发行人主体进行评级，在此基础上，进一步结合债券发行具体条款（主要是债券担保状况）对债券进行评级。根据信用债的评级，给予相应的信用风险溢价，与市场上的信用利差进行对比，发掘具备相对价值的个券。 （7）可转换债券和可交换债券投资策略 可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点，是本基金的重要投资对象之一。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入。 （8）证券公司短期公司债券投资策略 对于证券公司短期公司债券，本基金对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，综合考虑和分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、债券收益率等要素，确定投资决策。本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，并适当控制债券投资组合整体的久期，防范流动性风险。 6、资产支持证券投资策略
--	--

本基金将深入研究资产支持证券的发行条款、市场利率、支持资产的构成及质量、支持资产的现金流变动情况以及提前偿还率水平等因素，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，通过信用分析和流动性管理，辅以量化模型分析，精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资，力求获得长期稳定的投资收益。

7、证券投资基金投资策略

在基金投资上，本基金可投资全市场的股票 ETF 基金和本基金管理人旗下的股票型基金和应计入权益类资产的混合型基金，其中，计入上述权益类资产的混合型基金是指基金合同中明确约定股票投资比例不低于基金资产 60% 的混合型基金，或者根据定期报告披露情况，最近连续四个季度季末股票资产占基金资产的比例均在 60% 以上的混合型基金。

8、股指期货投资策略

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。并利用股指期货流动性较好的特点对冲基金的流动性风险，如大额申购赎回等。

9、国债期货投资策略

在风险可控的前提下，本基金将本着谨慎原则适度参与国债期货投资。本基金参与国债期货交易以套期保值为主要目的，运用国债期货对冲风险。本基金将根据对债券现货市场和期货市场的分析，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，发挥国债期货杠杆效应和流动性较好的特点，灵活运用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将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、对冲收益率曲线平坦、陡峭等形态变化的风险、对冲关键期限利率波动的风险；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。

10、信用衍生品投资策略

本基金投资信用衍生品，将按照风险管理的原则，以风险对冲为目的。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机

	构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、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。	
业绩比较基准	中债新综合全价（总值）指数收益率*80%+中证可转换债券指数收益率*5%+沪深 300 指数收益率*7%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*3%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%	
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。 本基金投资范围涉及法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，即本基金是一只涉及跨境证券投资的基金。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股通投资所面临的特别投资风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	泰康金泰回报 3 个月持有 A	泰康金泰回报 3 个月持有 C
下属分级基金的交易代码	003813	026219
报告期末下属分级基金的份额总额	142,954,796.95 份	2,861.51 份

§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（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日）	
	泰康金泰回报 3 个月持有 A	泰康金泰回报 3 个月持有 C
1. 本期已实现收益	634,018.83	65.76
2. 本期利润	667,363.05	81.99
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0043	0.0120
4. 期末基金资产净值	208,013,542.87	4,164.18
5. 期末基金份额净值	1.4551	1.4552

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

泰康金泰回报 3 个月持有 A

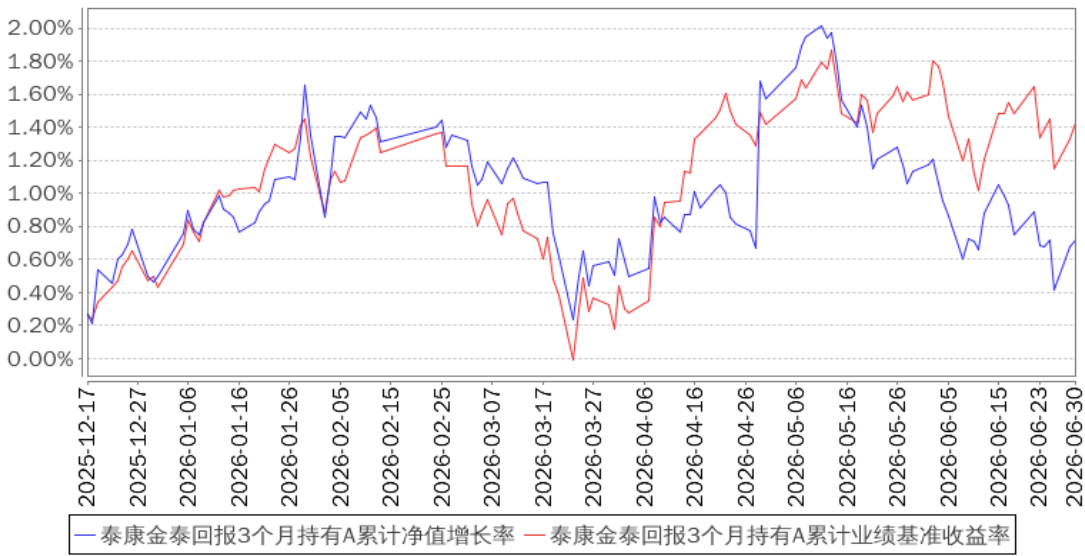
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.21%	0.19%	1.25%	0.15%	-1.04%	0.04%
过去六个月	0.22%	0.18%	0.99%	0.15%	-0.77%	0.03%
自基金合同 生效起至今	0.71%	0.17%	1.43%	0.15%	-0.72%	0.02%

泰康金泰回报 3 个月持有 C

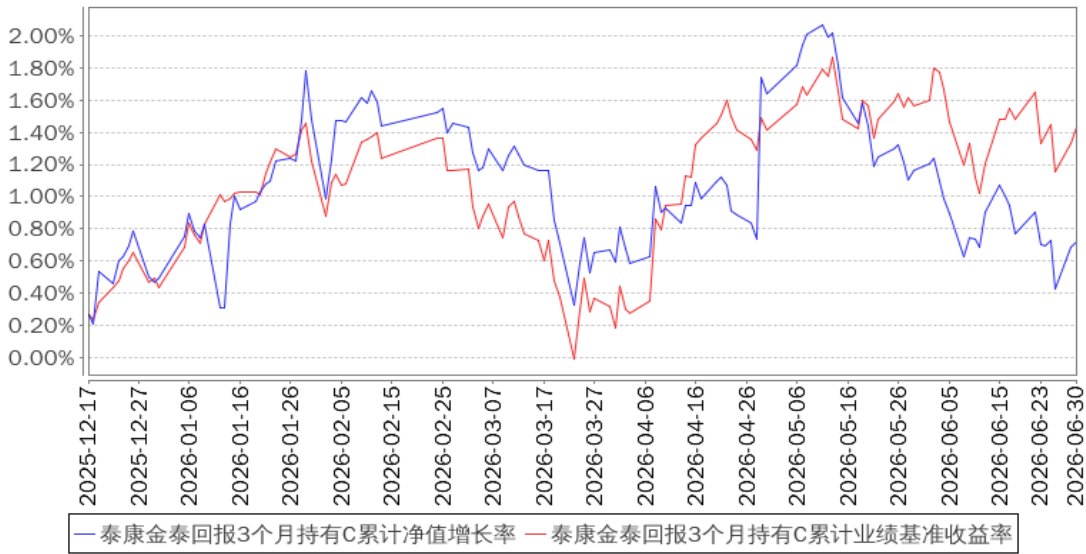
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.12%	0.19%	1.25%	0.15%	-1.13%	0.04%
过去六个月	0.23%	0.19%	0.99%	0.15%	-0.76%	0.04%
自基金合同 生效起至今	0.72%	0.19%	1.43%	0.15%	-0.71%	0.04%

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

泰康金泰回报3个月持有A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰康金泰回报3个月持有C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2025 年 12 月 17 日生效, 截止报告期末本基金未满一年。

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、副总经理、固定收益投资部负责人	2025 年 12 月 17 日	-	18 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 2025 年 12 月 16 日担任泰康金泰回报 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 2025 年 9 月 1 日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 2025 年 9 月 1 日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。2025 年 12 月 17 日至今担任泰康金泰回报 3 个月持有期混合型证券投资基金（原泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金）基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，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，二季度呈现外部事件冲击逐步减弱、经济结构分化加剧的特征。地缘层面，美伊冲突来回拉锯，6 月份双方终于达成了谅解备忘录，国际油价从高位明显回落。需求端呈现冷热分化格局，出口延续高增，背后主要驱动因素是 AI 产业链环节的出口价格暴涨；内需持续走弱，消费和投资表现不佳，新旧经济分化明显。目前 AI 的高景气还未能扩散到传统部门，叠加财政支出节奏偏慢，共同加剧了新旧经济分化。从通胀维度来看，二季度 PPI 同比明显上行，与油价和电子信息等产业链价格明显上涨有关，后续伴随油价明显回落，预计 PPI 将逐步筑顶。

债券市场方面，利率走势在二季度先下行后窄幅震荡，总体变动不大。从驱动因素来看，宏观经济在二季度的影响较为复杂，通胀抬升对债市形成压制，但传统内需部门持续走弱又构成底部支撑，多空力量相互对冲，构成了二季度偏震荡的土壤。流动性可能是二季度的交易主线，前期信贷需求偏弱叠加汇率升值预期带来广义流动性宽松，给债券形成支撑；进入 6 月，央行有意回笼了冗余流动性，引导资金利率向政策利率回归，债市随之转入窄幅震荡运行。

权益市场方面，2026 年第二季度整体呈现显著分化格局。从大盘指数整体表现上来看，二季度上证指数上涨 5.20%，沪深 300 上涨 11.90%，创业板指上涨 36.35%，恒生指数下跌 7.69%，恒生科技指数下跌 3.82%。申万一级行业表现来看，电子、通信、建筑材料、机械设备等行业表现相对较好，石油石化、农林牧渔、钢铁、商贸零售、美容护理、食品饮料等行业表现相对落后。

固收投资方面，宏观基本面角度内需偏弱、市场面角度配置需求仍偏强，有利于债市；但估值角度债市收益率仍处于历史偏低水平，因此收益率可能上行下行空间都不大。操作上，二季度久期整体维持在中性附近。

转债投资方面，二季度受权益结构性行情影响，转债市场结构分化明显，低价品种表现较差，高价品种表现相对较强。操作上，减持剩余期限短、转股可能性下降的转债标的，规避高价、高溢价率的转债标的，整体仓位小幅下降。

权益投资方面，报告期内权益市场行业分化巨大，操作上，含权仓位下降，并适当增配电子等行业，行业配置分散。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 份额净值为 1.4551 元,本报告期基金 A 份额净值增长率为 0.21%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.4552 元,本报告期基金 C 份额净值增长率为 0.12%；同期业绩比较基准增长率为 1.25%。

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	17,823,666.41	8.50
	其中：股票	17,823,666.41	8.50
2	基金投资	2,695,083.10	1.28
3	固定收益投资	99,898,618.22	47.62
	其中：债券	99,898,618.22	47.62
	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	55,002,390.41	26.22
	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	26,353,196.85	12.56
8	其他资产	7,993,387.14	3.81
9	合计	209,766,342.13	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,623,585.00 元，占期末资产净值比例为 0.78%

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	9,505.60	0.00
B	采矿业	190,808.00	0.09
C	制造业	8,380,357.76	4.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,663.00	0.02
E	建筑业	49,217.00	0.02
F	批发和零售业	73,761.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	25,804.00	0.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,345,312.05	1.13
J	金融业	4,488,822.00	2.16
K	房地产业	11,730.00	0.01
L	租赁和商务服务业	406,130.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	12,000.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	63,015.00	0.03
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	95,956.00	0.05
S	综合	—	—
	合计	16,200,081.41	7.79

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	1,067,220.00	0.51
B 消费者非必需品	—	—
C 消费者常用品	—	—
D 能源	34,700.00	0.02
E 金融	—	—
F 医疗保健	—	—
G 工业	—	—
H 信息技术	521,665.00	0.25
I 电信服务	—	—

J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	1,623,585.00	0.78

注：以上行业分类标准来源于财汇。

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	688256	寒武纪	1,071	1,708,834.05	0.82
2	002475	立讯精密	18,700	1,316,480.00	0.63
3	601318	中国平安	25,800	1,231,692.00	0.59
4	600887	伊利股份	44,600	1,068,616.00	0.51
5	01787	山东黄金	69,000	1,000,500.00	0.48
6	601628	中国人寿	26,600	940,310.00	0.45
7	601818	光大银行	299,800	866,422.00	0.42
8	002415	海康威视	23,400	800,280.00	0.38
9	002078	太阳纸业	62,500	780,625.00	0.38
10	601319	中国人保	106,700	721,292.00	0.35

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	10,024,273.22	4.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	44,354,268.49	21.32
	其中：政策性金融债	34,242,323.28	16.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	38,580,830.36	18.55
7	可转债（可交换债）	6,939,246.15	3.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	99,898,618.22	48.02

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	260401	26 农发 01	140,000	14,115,260.27	6.79
2	102484197	24 淮南矿 MTN002	100,000	10,246,727.67	4.93
3	250220	25 国开 20	100,000	10,222,186.30	4.91
4	232680001	26 工行二级资	100,000	10,111,945.21	4.86

		本债 01BC			
5	102482328	24 津城建 MTN024A	100,000	10,093,037.81	4.85

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；因未依法履行相关职责在本报告编制前一年内受到国家外汇管理局北京市分局的公开

处罚、公开批评。

中国工商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的公开处罚；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；因未依法履行相关职责在本报告编制前一年内受到国家外汇管理局北京市分局的公开处罚、公开批评。

中国农业发展银行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约定的备选股票库

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	13,350.28
2	应收证券清算款	7,958,967.17
3	应收股利	11,172.07
4	应收利息	—
5	应收申购款	9,897.62
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	7,993,387.14

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	861,351.10	0.41
2	113049	长汽转债	644,874.77	0.31
3	123107	温氏转债	480,725.50	0.23
4	123090	三诺转债	432,171.95	0.21
5	113062	常银转债	423,523.44	0.20
6	113616	韦尔转债	389,649.63	0.19
7	111017	蓝天转债	319,442.46	0.15
8	127089	晶澳转债	316,025.70	0.15
9	113052	兴业转债	295,775.24	0.14
10	113696	伯 25 转债	178,100.00	0.09
11	110085	通 22 转债	169,046.07	0.08

12	113648	巨星转债	159,950.16	0.08
13	113634	珀莱转债	138,083.42	0.07
14	123250	嘉益转债	136,478.44	0.07
15	118024	冠宇转债	132,510.16	0.06
16	113652	伟 22 转债	117,017.77	0.06
17	113647	禾丰转债	110,962.72	0.05
18	127056	中特转债	102,444.12	0.05
19	127108	太能转债	85,983.17	0.04
20	113661	福 22 转债	72,741.02	0.03
21	113692	保隆转债	68,914.88	0.03
22	113053	隆 22 转债	66,690.80	0.03
23	110093	神马转债	65,800.80	0.03
24	113070	渝水转债	64,376.87	0.03
25	127072	博实转债	55,925.99	0.03
26	127085	韵达转债	50,318.65	0.02
27	113666	爱玛转债	48,268.33	0.02
28	113054	绿动转债	46,248.97	0.02
29	113625	江山转债	38,923.71	0.02
30	127030	盛虹转债	38,109.30	0.02
31	111015	东亚转债	35,925.56	0.02
32	113650	博 22 转债	33,048.60	0.02
33	113067	燃 23 转债	29,413.06	0.01
34	123183	海顺转债	27,199.75	0.01
35	123109	昌红转债	27,079.67	0.01
36	113660	寿 22 转债	26,363.26	0.01
37	113636	甬金转债	26,301.18	0.01
38	128138	侨银转债	25,899.21	0.01
39	123117	健帆转债	25,756.57	0.01
40	123192	科思转债	25,752.24	0.01
41	113659	莱克转债	25,394.96	0.01
42	123104	卫宁转债	25,239.81	0.01
43	123193	海能转债	24,891.95	0.01
44	123138	丝路转债	24,822.60	0.01
45	113682	益丰转债	24,620.16	0.01
46	123168	惠云转债	24,554.66	0.01
47	118032	建龙转债	24,523.62	0.01
48	127034	绿茵转债	24,461.53	0.01
49	113679	芯能转债	23,940.71	0.01
50	127044	蒙娜转债	23,889.70	0.01
51	111009	盛泰转债	23,757.18	0.01
52	123144	裕兴转债	23,699.01	0.01
53	113670	金 23 转债	23,681.32	0.01

54	113665	汇通转债	23,642.19	0.01
55	118022	锂科转债	23,500.93	0.01
56	113627	太平转债	22,764.95	0.01
57	127060	湘佳转债	22,687.20	0.01
58	128142	新乳转债	22,628.96	0.01
59	110090	爱迪转债	21,440.11	0.01
60	127025	冀东转债	21,068.66	0.01
61	110087	天业转债	20,267.67	0.01
62	111002	特纸转债	16,276.65	0.01
63	118037	上声转债	13,964.39	0.01
64	113056	重银转债	12,456.79	0.01
65	123194	百洋转债	5,081.46	0.00
66	113658	密卫转债	2,814.74	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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资 产净值比 例 (%)	是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金
1	512000	华宝中证全指证券公司 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,404,700.00	754,323.90	0.36	否
2	515180	易方达中证红利 ETF	交易型开放式 (ETF)	414,500.00	529,316.50	0.25	否
3	159755	电池 ETF	交易型开放式 (ETF)	444,800.00	489,280.00	0.24	否
4	512800	华宝中证银行 ETF	交易型开放式 (ETF)	465,700.00	341,823.80	0.16	否
5	515880	国泰中证全指通信设备 ETF	交易型开放式 (ETF)	128,600.00	230,965.60	0.11	否

6	515050	华夏中证 5G 通信主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	148,500.00	207,454.50	0.10	否
7	512690	鹏华中证酒 ETF	交易型开放式 (ETF)	336,100.00	132,087.30	0.06	否
8	563360	中证 A500ETF 基金	交易型开放式 (ETF)	5,400.00	7,673.40	0.00	否
9	510050	华夏上证 50ETF	交易型开放式 (ETF)	700.00	2,158.10	0.00	否

注：本基金为混合型基金，本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金，本基金管理人根据基金合同约定并参照《证券投资基金信息披露 XBRL 模板》中“基金中基金”的要求披露本报告期投资基金的情况。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	—	—
当期交易基金产生的赎回费（元）	—	—
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	—	—
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	3,816.20	—
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	839.66	—

注：（1）当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。根据本基金合同的约定，本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的其他基金份额的部分不收取管理费，本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的其他基金份额的部分不收取托管费。

（2）根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际

申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的基金未发生重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康金泰回报 3 个月持有 A	泰康金泰回报 3 个月持有 C
报告期期初基金份额总额	165,229,262.36	9,398.33
报告期期间基金总申购份额	1,259,450.28	95.13
减:报告期期间基金总赎回份额	23,533,915.69	6,631.95
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	142,954,796.95	2,861.51

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。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

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

10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 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

2026 年 7 月 20 日