泰康丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 22 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 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰康丰泰一年定开债券发起
基金主代码	015712
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2022 年 9 月 28 日
报告期末基金份额总额	973,621,117.82 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	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。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。
业绩比较基准	中债新综合全价（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。
基金管理人	泰康基金管理有限公司

基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	4,019,384.63
2.本期利润	4,838,199.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.0050
4.期末基金资产净值	1,103,931,298.08
5.期末基金份额净值	1.1338

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。

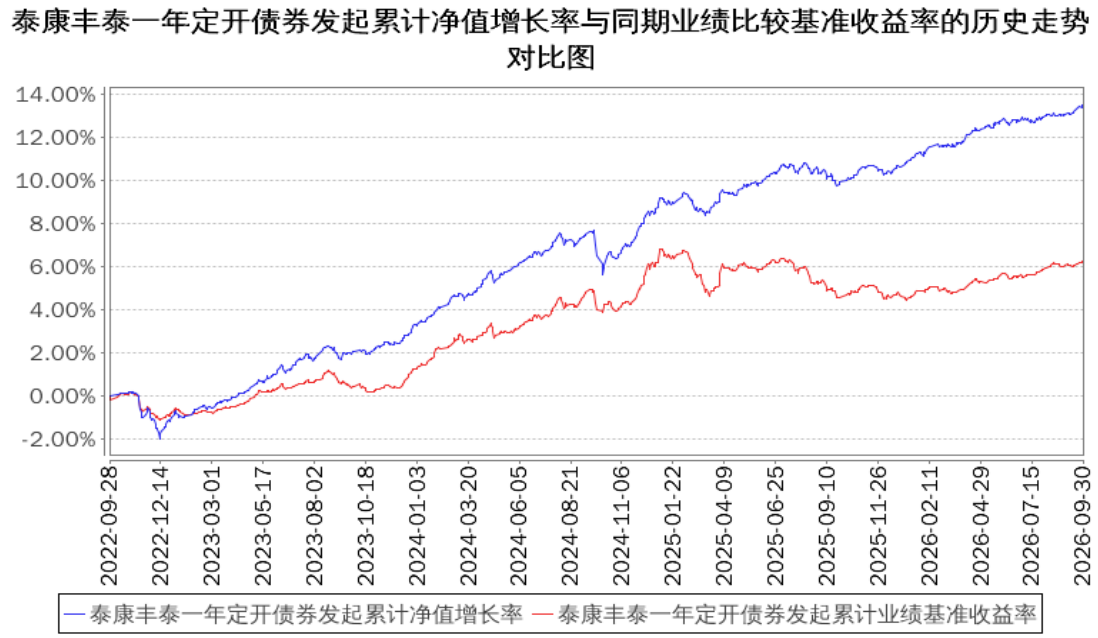
（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.43%	0.05%	0.52%	0.03%	-0.09%	0.02%
过去六个月	1.51%	0.05%	1.15%	0.03%	0.36%	0.02%
过去一年	3.16%	0.05%	1.48%	0.04%	1.68%	0.01%
过去三年	11.07%	0.07%	5.66%	0.07%	5.41%	0.00%
自基金合同生效起至今	13.38%	0.08%	6.15%	0.07%	7.23%	0.01%

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



注：1、本基金基金合同于 2022 年 09 月 28 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		
吴斯泓	本基金基金经理	2023 年 4 月 25 日	-	10 年	吴斯泓，硕士研究生。2016 年 7 月加入泰康公募，历任固定收益研究员、固定收益基金经理助理，现任泰康基金固定收益基金经理。2022 年 9 月 6 日至今担任泰康安欣纯债债券型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 29 日至今担任泰康安泓纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 25 日至今担任泰康丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 29 日至今担任泰康中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。2024 年 9 月 3 日至今担任泰康丰盛纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 28 日至今担

					任泰康中债 1-5 年政策性金融债指数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遵规守信情况的说明

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，在严格控制风险的基础上，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，三季度呈现地缘冲突再度升级、经济结构分化加剧的特征。地缘层面，美伊 6 月达成谅解备忘录后，7 月冲突再度发酵，霍尔木兹海峡航运受阻，国际油价大幅上行。海外方面，输入性通胀叠加就业韧性，美联储 9 月重启加息，美债收益率大幅上行，10 年期美债重回 5%上方、创 2007 年以来新高，带动全球长端利率同步走高。国内需求端则延续“外热内冷”格局，AI 产业链量价齐升支撑出口高增，但内需持续走弱，消费、投资表现偏弱，实体融资需求延续走弱；AI 高景气仍集中于新经济部门，叠加财政发力偏克制、政府债发行节奏较慢，新旧经济分化进一步加大。通胀端，PPI 同比受油价扰动高位震荡，但核心通胀持续低位，内需主

导的通胀压力有限。

债券市场方面，三季度利率整体震荡下行，超长端表现显著占优。7 月中下旬起，市场风险偏好回落，叠加政治局会议政策基调克制、金融数据走弱，债市进入利率下行通道；8 月下旬受季节性通胀担忧、海外长端利率上行影响，债市出现阶段性回调。进入 9 月，央行精细化呵护跨季流动性，资产荒下欠配机构增配长久期品种，超长端领涨，30 年期收益率下破 2.10%，收益率曲线明显平坦化。从驱动逻辑看，三季度债市受国内基本面影响偏多，内需走弱构成核心支撑；政策保持定力的情况下，市场持续压缩利差，海外加息对国内债市冲击明显钝化，“以我为主”贯穿三季度行情始终。

投资操作来看，基金在底仓品种上，专注于票息资产的挖掘；同时，灵活根据市场节奏调整组合久期、动态调整转债的仓位和结构，阶段性把握利率债特别是超长债的交易机会。

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 1.1338 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.43%；同期业绩比较基准增长率为 0.52%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,578,693,214.12	99.00
	其中：债券	1,578,693,214.12	99.00
	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	15,863,208.11	0.99
8	其他资产	23,900.59	0.00

9	合计	1,594,580,322.82	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	152,621,867.13	13.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	252,908,620.82	22.91
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	273,738,444.39	24.80
5	企业短期融资券	10,298,993.42	0.93
6	中期票据	859,732,605.50	77.88
7	可转债（可交换债）	29,392,682.86	2.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,578,693,214.12	143.01

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	2600006	26 超长特别国债 06	1,000,000	101,153,315.22	9.16
2	2600004	26 超长特别国债 04	500,000	51,468,551.91	4.66
3	102585129	25 滨建投 MTN008	300,000	31,009,737.53	2.81
4	102584672	25 云投 MTN014A	300,000	30,947,730.41	2.80
5	102585163	25 济南高新 MTN011	300,000	30,882,159.45	2.80

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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

华夏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。

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国家外汇管理局北京市分局的公开处罚；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宁波监管局的公开处罚；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国家金融监督管理总局的公开处罚；其信用卡中心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国家金融监督管理总局北京监管局的公开处罚。

上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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。

5.10.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	14,070.77
2	应收证券清算款	9,829.82
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	23,900.59

5.10.4 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	113052	兴业转债	1,403,449.67	0.13
2	113056	重银转债	908,657.40	0.08
3	127089	晶澳转债	623,513.30	0.06
4	113062	常银转债	590,867.44	0.05
5	110093	神马转债	511,379.88	0.05
6	123216	科顺转债	505,878.78	0.05
7	127064	杭氧转债	471,249.11	0.04
8	113691	和邦转债	469,841.44	0.04
9	123149	通裕转债	449,247.25	0.04
10	123247	万凯转债	447,702.05	0.04
11	110090	爱迪转债	437,102.05	0.04
12	113049	长汽转债	429,362.14	0.04
13	123215	铭利转债	422,164.26	0.04
14	127045	牧原转债	414,045.37	0.04
15	118031	天 23 转债	409,836.58	0.04
16	127110	广核转债	409,600.93	0.04
17	113681	镇洋转债	409,451.84	0.04
18	110077	洪城转债	401,559.45	0.04
19	113046	金田转债	401,541.10	0.04
20	127025	冀东转债	391,632.33	0.04
21	118022	锂科转债	385,936.48	0.03
22	113640	苏利转债	384,271.86	0.03
23	123142	申昊转债	374,148.82	0.03
24	123257	安克转债	363,798.48	0.03
25	123235	亿田转债	363,204.93	0.03

26	113647	禾丰转债	361,667.66	0.03
27	113659	莱克转债	353,075.75	0.03
28	118034	晶能转债	347,067.53	0.03
29	113677	华懋转债	339,163.07	0.03
30	110095	双良转债	337,672.60	0.03
31	113053	隆 22 转债	335,111.03	0.03
32	123124	晶瑞转 2	334,878.63	0.03
33	123168	惠云转债	323,051.81	0.03
34	118065	艾为转债	321,051.16	0.03
35	113627	太平转债	314,576.88	0.03
36	118015	芯海转债	313,868.61	0.03
37	113665	汇通转债	311,574.90	0.03
38	127062	垒知转债	311,231.39	0.03
39	113067	燃 23 转债	309,165.71	0.03
40	110085	通 22 转债	301,133.28	0.03
41	123114	三角转债	300,295.55	0.03
42	113649	丰山转债	298,796.52	0.03
43	113048	晶科转债	293,814.96	0.03
44	127037	银轮转债	287,418.95	0.03
45	113695	华辰转债	283,040.60	0.03
46	127038	国微转债	278,313.36	0.03
47	123225	翔丰转债	276,000.55	0.03
48	113699	金 25 转债	273,289.93	0.02
49	123176	精测转 2	273,000.19	0.02
50	127084	柳工转 2	268,996.16	0.02
51	111015	东亚转债	265,992.05	0.02
52	123172	漱玉转债	263,406.85	0.02
53	123183	海顺转债	258,102.47	0.02
54	123171	共同转债	257,342.36	0.02
55	118039	煜邦转债	255,752.00	0.02
56	127070	大中转债	244,997.53	0.02
57	118064	联瑞转债	241,502.64	0.02
58	113652	伟 22 转债	240,700.22	0.02
59	123131	奥飞转债	240,004.79	0.02
60	127088	赫达转债	239,603.84	0.02
61	127030	盛虹转债	237,176.72	0.02
62	113042	上银转债	236,120.76	0.02
63	123252	银邦转债	220,566.34	0.02
64	123158	宙邦转债	212,399.75	0.02
65	127031	洋丰转债	210,557.35	0.02
66	127112	尚太转债	202,997.83	0.02
67	123262	神宇转债	191,308.32	0.02

68	118059	颀中转债	190,415.53	0.02
69	118063	金 05 转债	169,014.21	0.02
70	113678	中贝转债	167,878.32	0.02
71	118058	微导转债	159,764.55	0.01
72	118062	天准转债	155,298.44	0.01
73	127078	优彩转债	153,608.05	0.01
74	123241	欧通转债	148,717.15	0.01

5.10.5 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。

5.10.6 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	973,621,117.82
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	973,621,117.82

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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有 10,000,450.02 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2022 年 9 月 28 日至 2025 年 9 月 27 日。截至本报告期末，发起资金持有份额为 0 份。

§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丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件；

（二）《泰康丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；

（三）《泰康丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；

（四）《泰康丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；

（五）《泰康丰泰一年定期开放债券型发起式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（《证券时报》）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 10 月 26 日