泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）
2026 年中期报告

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

送出日期：2026 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、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。

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 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

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 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 7

3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 其他指标 9

§4 管理人报告 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
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 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15

6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19

§7 投资组合报告 44

7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 44
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 45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 48
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 48
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 48

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 48
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 48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 48
7.12 本报告期投资基金情况 48
7.13 投资组合报告附注 56
§8 基金份额持有人信息 57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 57
8.2 盈利投资者数量占比 57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 57
8.4 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 57
§9 开放式基金份额变动 59
§10 重大事件揭示 60
10.1 基金份额持有人大会决议 60
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 60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 60
10.4 基金投资策略的改变 60
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 60
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 60
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 60
10.9 其他重大事件 66
§11 影响投资者决策的其他重要信息 68
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 68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 68
§12 备查文件目录 69
12.1 备查文件目录 69
12.2 存放地点 69
12.3 查阅方式 69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）	
基金主代码	012458	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 20 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	797,830,969.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）Y
下属分级基金的交易代码	012458	017391
报告期末下属分级基金的份额总额	796,430,581.97 份	1,400,387.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用目标风险策略，在控制风险的前提下，通过优选各类型公开募集证券投资基金构建组合，力争获取超越业绩基准的收益，实现养老资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用目标风险策略，在控制风险的前提下，通过优选各类型公开募集证券投资基金构建组合，力争获取超越业绩基准的收益，实现养老资产的长期稳健增值。本基金采用目标风险策略，为目标风险系列中相对稳健的产品。结合基金管理人研发的投资决策体系，在控制风险的前提下，对各类资产的配置比例进行战术调整，力争通过基金管理人的主动配置把握各大类资产中长期趋势波动带来的 Beta 收益，获取更优异的风险调整回报。基金管理人将对全市场的主动型基金和被动型基金进行业绩分析、组合分析、费率比较、流动性比较等，权衡主动型基金和被动型基金的相对优势，在权益类、固收类和商品类的内部确定主动和被动的配置比例，并进行动态调整。对于主动管理型基金，基金管理人创立了“以基金经理为核心”的研究体系，覆盖全市场各种风格的基金经理和基金产品，基金将结合对市场风格、结构轮动的判断，选取部分投资风格适合当前市场、评价打分较高的基金经理所管理的基金进行组合投资；在被动指数型基金的筛选上，本基金将首先结合基金管理人对市场结构走势的判断，将适合当前市场的、已开发成基金的指数产品筛选出来，通过综合比较来选择优质的指数基金进行投资。 股票投资上，本 FOF 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，精选具有较高投资价值的上市公司，进行股票的选择与组合优化。同时，本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，投资于债券资产。债券投资策略包括：久期管理策略；期限结构配置策略；骑乘策略；息差策略；信用策略；个券精选策略；证券公司短期公司债券投资策略；可转换债券投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*20%+中债新综合全价（总值）指数收益率*75%+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中基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

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 4 至 5 层 1-14 内 5 层 501	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 B 座 5、6 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100031	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	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金中期报告置备地点	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	北京市西城区复兴门内大街 156 号 B 座 5、6 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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）Y
本期已实现收益	6,970,949.25	21,020.90
本期利润	25,808,074.09	67,861.91
加权平均基金份额本期利润	0.0489	0.0520
本期加权平均净值利润率	4.54%	4.64%
本期基金份额净值增长率	4.61%	4.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	49,162,020.77	148,230.53
期末可供分配基金份额利润	0.0617	0.1058
期末基金资产净值	881,007,143.51	1,614,002.82
期末基金份额净值	1.1062	1.1525
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	10.62%	15.25%

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

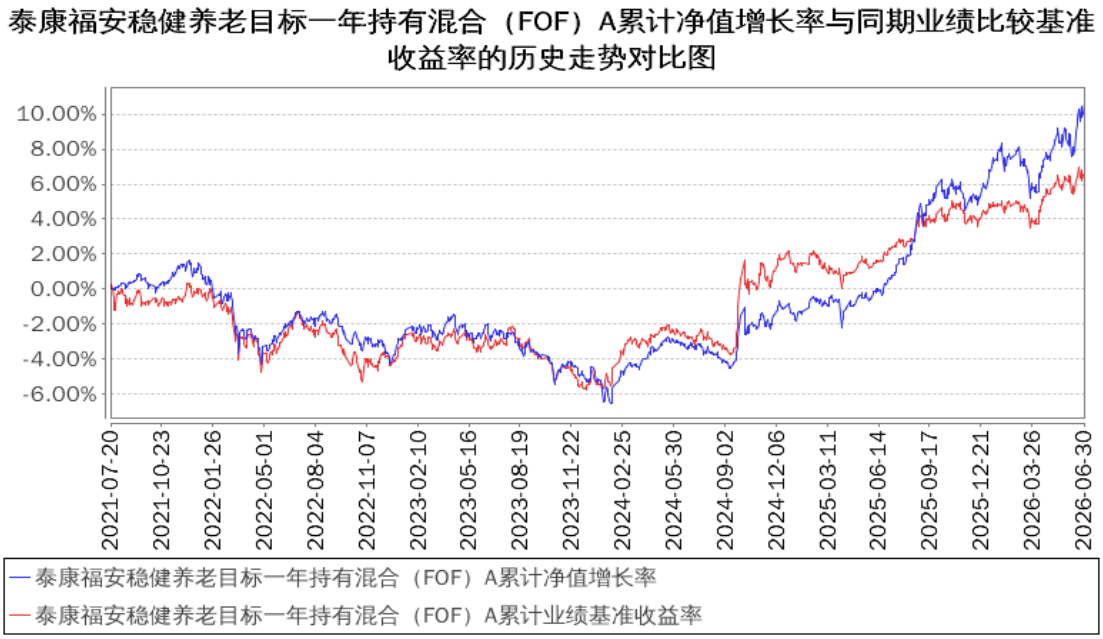
泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A

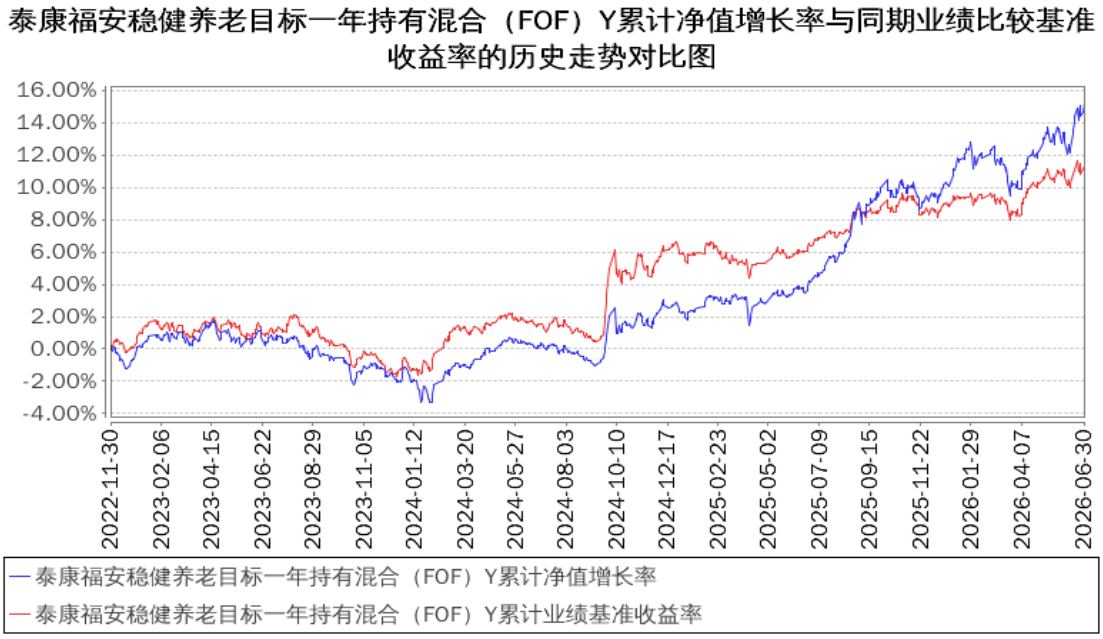
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	4.75%	0.36%	2.83%	0.26%	1.92%	0.10%
过去六个月	4.61%	0.35%	2.29%	0.23%	2.32%	0.12%
过去一年	10.18%	0.30%	4.61%	0.20%	5.57%	0.10%
过去三年	13.41%	0.24%	10.22%	0.21%	3.19%	0.03%
自基金合同生效起至今	10.62%	0.23%	6.68%	0.22%	3.94%	0.01%

泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）Y

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
过去三个月	4.83%	0.36%	2.83%	0.26%	2.00%	0.10%
过去六个月	4.76%	0.35%	2.29%	0.23%	2.47%	0.12%
过去一年	10.51%	0.30%	4.61%	0.20%	5.90%	0.10%
过去三年	14.43%	0.24%	10.22%	0.21%	4.21%	0.03%
自基金合同生效起至今	15.25%	0.23%	11.32%	0.21%	3.93%	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





注：1、本基金基金合同于 2021 年 07 月 20 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 2026 年 6 月 30 日，泰康基金共管理 93 只证券投资基金。旗下产品已形成了包括货币、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，旗下公募基金覆盖沪深 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		
马双	本基金基金经理	2023 年 8 月 11 日	-	9 年	马双，硕士研究生。2023 年 1 月加入泰康基金，现任 FOF 基金经理。曾任上海浦东发展银行股份有限公司总行选备生、流动性管理岗、浦银理财有限责任公司多资产投资经理等职务。2023 年 8 月 11 日至今担任泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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 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

2026 年上半年国内 GDP 一季度同比增长 5.0%，二季度同比增长 4.3%，经济运行整体在合理区间，其中新动能成长迅速。

报告期内国内政策环境持续发力、精准滴灌。稳增长、促创新、扩内需政策密集落地，产业政策深入实施“人工智能+”行动，加快建设现代化产业体系，推动科技创新和产业创新深度融合，资本市场改革持续推进，长期资金入市引导力度不减，为市场稳定运行提供坚实支撑。

除宏观经济与政策的托举外，国内新质生产力培育壮大、AI 产业加速发展是上半年经济运行最鲜明的特征。全国一体化算力网建设加速推进，智能算力规模保持高速增长；AI 产业链在资本市场和生产端均表现突出，电子信息、AI 算力设备及相关产业链成为制造业修复的重要支撑，半导体、光模块、PCB、先进封装等硬件板块表现亮眼。

总体而言，2026 年上半年国内经济顶住外部压力，运行在合理区间，高质量发展向新向优的特征明显，政策发力精准有效，产业结构持续优化，为基金运作提供了良好的国内基础。但也要看到，国内供强需弱的矛盾仍较突出，经济向好基础还需进一步巩固。

海外方面，2026 年上半年全球经济与资产价格剧烈分化。美国经济整体呈现韧性，但结构性问题凸显，K 型分化特征明显：产业方面 AI 投资一枝独秀，科技巨头资本开支维持高位，半导体、数据中心等产业链景气度居高不下；消费方面则主要由高收入人群支撑，中低收入群体受高利率和高物价挤压，消费能力与信心承压。再通胀压力因中东地缘冲突、国际油价脉冲式上涨而升温，美联储政策预期由鸽转鹰，新任主席首秀释放偏鹰信号，10 年期美债收益率攀升，美元维持强势。

产品运作方面，报告期内基于全球格局变化与产业发展的背景，组合持续优化资产配置。组合减配了贵金属，对权益类资产聚焦 AI 算力、半导体、先进制造等景气赛道，采用灵活轮动策略捕捉阶段性机会；固收方面拉长了组合久期。

4.4.2 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 1.1062 元,本报告期基金 A 份额净值增长率为 4.61%；截至本报告期末本基金 Y 份额净值为 1.1525 元,本报告期基金 Y 份额净值增长率为 4.76%；同期业绩比较基准增长率为 2.29%。

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 2026 年下半年，国内经济有望延续稳中有进、向新向优的发展态势。这一判断背后，是多重积极因素的支撑：尽管仍面临有效需求不足、供强需弱等结构性挑战，但随着稳增长、促创新、扩内需政策的持续落地，国内实体经济复苏动能有望进一步释放；AI、半导体、高端装备等新兴产业将逐步成为经济增长的核心引擎，新质生产力对经济增长的贡献有望继续提升；同时，资本市场呵护态度预计延续，长期资金入市、资本市场制度改革等政策将持续改善市场生态。政策层面预计将继续出台举措，巩固经济复苏成果，应对外部环境变化。

但也要看到，下半年经济向好基础还需进一步巩固。国内消费需求恢复仍需时间，房地产市场仍在筑底回稳过程中，部分传统行业和下游产业复苏偏慢，企业盈利修复的结构性分化可能延续。

海外方面，美国自身结构性问题能否得到改善——AI 投资热潮能否从硬件资本开支向全行业应用与生产率提升渗透、中低收入群体消费能否持续改善、劳动力市场能否保持稳健——将成为影响其经济走势的关键，进而传导至全球资本市场。

美联储货币政策方面，上半年偏鹰派立场给全球资产定价带来压力。展望下半年，若国际油价回落、通胀预期降温，美联储货币政策有望边际缓和，但降息幅度和节奏仍存在较大不确定性。全球主要央行政策分化、地缘政治冲突、能源价格波动等因素仍可能加剧全球金融市场波动。

基于以上判断，资产配置方面，2026 年下半年组合将紧密跟踪国内外经济变化情况，持续采用权益、固收、商品等多元资产轮动的运作模式。权益方面，除了关注 AI 产业链（算力、半导体、先进封装、光通信等）、高端制造、国产替代等科技成长景气赛道外，同时也要逐步关注估值回调后的消费、医药、红利低波等板块的修复机会；固收方面，合理控制久期，把握利率波动中的配置机会；商品方面，黄金作为对冲全球地缘风险与货币体系重构的工具，仍将保持关注，但需警惕利率高位和美元强势对金价的阶段性压制。整体上，组合将在有效对冲全球市场波动风险的同时，积极捕捉各类资产的阶段性超额收益。

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、专户业务部）、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遵规守信情况声明

托管人声明:

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本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：泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	31,147,367.59	481,901.89
结算备付金		2,066,171.35	898,426.99
存出保证金		146,426.15	41,402.56
交易性金融资产	6.4.7.2	810,025,711.24	200,224,907.67
其中：股票投资		28,500,585.44	1,325,158.72
基金投资		734,436,183.28	186,781,700.19
债券投资		47,088,942.52	12,118,048.76
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	-	15,996,482.14
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		20,122,932.93	1,290,268.53
应收股利		-	91,268.70
应收申购款		23,172,681.70	2,361,061.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	51,487.37	7,328.70
资产总计		886,732,778.33	221,393,048.98
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		-	-
应付清算款		2,531,688.18	-
应付赎回款		951,614.31	1,497,272.27

应付管理人报酬		293,902.46	89,614.56
应付托管费		81,497.27	25,303.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		92,687.42	7,309.34
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	160,242.36	37,913.91
负债合计		4,111,632.00	1,657,413.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	797,830,969.14	207,744,657.09
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	84,790,177.19	11,990,978.17
净资产合计		882,621,146.33	219,735,635.26
负债和净资产总计		886,732,778.33	221,393,048.98

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日,基金份额总额 797,830,969.14 份，其中泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A 基金份额总额 796,430,581.97 份，基金份额净值 1.1062 元;泰康福安稳健养老目标一年持有混合(FOF)Y 基金份额总额 1,400,387.17 份，基金份额净值 1.1525 元。

6.2 利润表

会计主体：泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		27,721,306.03	4,087,571.82
1.利息收入		147,523.33	85,639.81
其中：存款利息收入	6.4.7.13	68,571.52	60,251.31
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		78,951.81	25,388.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,540,183.32	7,426,069.67
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-488,639.58	64,152.91
基金投资收益	6.4.7.15	7,474,225.71	6,293,635.57
债券投资收益	6.4.7.16	221,981.33	143,342.46
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	1,332,615.86	924,938.73
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	18,883,965.85	-3,452,589.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	149,633.53	28,452.30
减：二、营业总支出		1,845,370.03	866,391.97
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,366,010.19	607,076.85
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	366,445.03	164,927.92
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7．税金及附加		22,544.65	8,307.20
8．其他费用	6.4.7.25	90,370.16	86,080.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,875,936.00	3,221,179.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,875,936.00	3,221,179.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		25,875,936.00	3,221,179.85

6.3 净资产变动表

会计主体：泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	207,744,657.09	-	11,990,978.17	219,735,635.26

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	207,744,657.09	-	11,990,978.17	219,735,635.26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	590,086,312.05	-	72,799,199.02	662,885,511.07
（一）、综合收益总额	-	-	25,875,936.00	25,875,936.00
（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）	590,086,312.05	-	46,923,263.02	637,009,575.07
其中：1.基金申购款	613,649,863.70	-	48,687,513.37	662,337,377.07
2.基金赎回款	-23,563,551.65	-	-1,764,250.35	-25,327,802.00
（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	797,830,969.14	-	84,790,177.19	882,621,146.33

项目	上年度可比期间 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、上期期末净资产	297,933,302.14	-	-2,858,797.86	295,074,504.28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	297,933,302.14	-	-2,858,797.86	295,074,504.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-86,883,604.82	-	3,741,615.06	-83,141,989.76
（一）、综合收益总额	-	-	3,221,179.85	3,221,179.85
（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）	-86,883,604.82	-	520,435.21	-86,363,169.61
其中：1.基金申购款	240,276.67	-	2,449.37	242,726.04
2.基金赎回款	-87,123,881.49	-	517,985.84	-86,605,895.65
（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	211,049,697.32	-	882,817.20	211,932,514.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

金志刚	金志刚	李俊佑
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) （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 [2021] 1410 号《关于准予泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 注册的批复》核准，由泰康资产管理有限责任公司 （以下简称“泰康资产”） 依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康福

安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 （FOF） 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的开放式基金，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 1,042,018,131.14 元，业经毕马威华振会计师事务所 （特殊普通合伙） 毕马威华振验字第 2100893 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 （FOF） 基金合同》于 2021 年 7 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,042,398,621.21 份基金份额，其中认购资金利息折合 380,490.07 份基金份额。本基金的原基金管理人为泰康资产，基金托管人为招商银行股份有限公司 （以下简称“招商银行”）。

根据《泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 （FOF） 基金合同》及《关于泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 （FOF） 新增 Y 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告》，泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 （FOF） 于 2022 年 11 月 18 日起增设 Y 类基金份额 （基金代码：017391），同时原基金份额 （基金代码：012458） 变更为 A 类基金份额。通过非个人养老金资金账户申购的一类份额，称为 A 类基金份额；针对个人养老金投资基金业务单独设立的一类基金份额，称为 Y 类基金份额。Y 类基金份额的申赎安排、资金账户管理等事项还应当遵守国家关于个人养老金账户管理的规定。在向投资人充分披露的情况下，为鼓励投资人在个人养老金领取期长期领取，基金管理人可设置定期分红、定期支付、定额赎回等机制；基金管理人亦可对运作方式、持有期限、投资策略、估值方法、申赎转换等方面做出其他安排。具体见更新的招募说明书及相关公告。由于基金费用等的不同，本基金 A 类基金份额和 Y 类基金份额将分别计算基金份额净值。计算公式为计算日该类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额余额总数。

泰康基金管理有限公司 （以下简称“泰康基金”） 于 2022 年 11 月 18 日发布《泰康基金管理有限公司关于变更基金管理人并修订基金合同及托管协议的公告》，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，按照《泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 （FOF） 基金合同》约定，经与基金托管人协商一致，本基金的基金管理人自 2022 年 11 月 18 日起由泰康资产变更为泰康基金。泰康基金已对《泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 （FOF） 基金合同》及《泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 （FOF） 托管协议》等法律文件中涉及基金管理人的相关条款完成修改，修改后的法律文件自 2022 年 11 月 18 日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 （FOF） 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，包括国内经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金份额 （含 QDII 基金、香港互认基金、公

开募集基础设施证券投资基金 （以下简称“公募 REITs”）)、股票 （包含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券 （包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换公司债券 （含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换公司债券、公开发行的次级债等)、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、同业存单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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%；其中，投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金 （含商品期货基金和黄金 ETF） 等品种的比例合计不超过基金资产的 30%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于权益类资产 （包括股票、股票型基金、在基金合同中载明股票资产占基金资产的比例下限大于等于 60%或最近四个季度定期报告披露的股票资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金） 的投资比例中枢为 25%。其中，权益类资产向上、向下的调整幅度最高分别为 5%及 10%，即权益类资产占基金资产的比例为 15%-30%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*20%+中债新综合全价 （总值） 指数收益率*75％+金融机构人民币活期存款利率 （税后） *5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部 （以下简称“财政部”） 颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入， 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税

直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b)对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c)对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

(d)本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	31,147,367.59
等于：本金	31,142,090.26
加：应计利息	5,277.33
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	31,147,367.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		23,540,382.09	-	28,500,585.44	4,960,203.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	46,653,793.00	456,322.52	47,088,942.52	-21,173.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	46,653,793.00	456,322.52	47,088,942.52	-21,173.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		714,247,467.12	-	734,436,183.28	20,188,716.16
其他		-	-	-	-
合计		784,441,642.21	456,322.52	810,025,711.24	25,127,746.51

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	51,487.37
待摊费用	-
合计	51,487.37

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	82,846.42
其中：交易所市场	82,846.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	77,395.94
合计	160,242.36

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,702,353.17	206,702,353.17
本期申购	613,222,120.55	613,222,120.55
本期赎回（以“-”号填列）	-23,493,891.75	-23,493,891.75
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	796,430,581.97	796,430,581.97

泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）Y

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,042,303.92	1,042,303.92
本期申购	427,743.15	427,743.15
本期赎回（以“-”号填列）	-69,659.90	-69,659.90
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	1,400,387.17	1,400,387.17

注：申购含红利再投、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

泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,840,188.01	2,046,440.96	11,886,628.97
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,840,188.01	2,046,440.96	11,886,628.97
本期利润	6,970,949.25	18,837,124.84	25,808,074.09
本期基金份额交易产生的变动数	32,350,883.51	14,530,974.97	46,881,858.48
其中：基金申购款	33,600,760.00	15,037,320.22	48,638,080.22

基金赎回款	-1,249,876.49	-506,345.25	-1,756,221.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,162,020.77	35,414,540.77	84,576,561.54

泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	93,201.36	11,147.84	104,349.20
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	93,201.36	11,147.84	104,349.20
本期利润	21,020.90	46,841.01	67,861.91
本期基金份额交易产生的变动数	34,008.27	7,396.27	41,404.54
其中：基金申购款	40,562.26	8,870.89	49,433.15
基金赎回款	-6,553.99	-1,474.62	-8,028.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	148,230.53	65,385.12	213,615.65

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	64,500.23
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	3,912.37
其他	158.92
合计	68,571.52

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-488,639.58
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-488,639.58

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	117,111,052.24
减：卖出股票成本总额	117,412,746.59
减：交易费用	186,945.23
买卖股票差价收入	-488,639.58

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,010,919,756.76
减：卖出/赎回基金成本总额	1,003,099,165.25
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	182,109.33
减：交易费用	164,256.47
基金投资收益	7,474,225.71

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	198,057.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	23,924.00
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	221,981.33

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	21,983,894.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,744,020.00
减：应计利息总额	215,950.15
减：交易费用	-

买卖债券差价收入	23,924.00

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	42,207.44
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,290,408.42
合计	1,332,615.86

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	18,883,965.85
股票投资	4,928,992.75
债券投资	-54,553.00
资产支持证券投资	-
基金投资	14,009,526.10
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
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	18,883,965.85

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	149,633.53
合计	149,633.53

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中：申购费补差收取具体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	233,270.55
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	774,725.98
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	210,421.77

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进

行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	13,388.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	8,474.22
债券账户维护费	9,000.00
合计	90,370.16

6.4.7.26 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,366,010.19	607,076.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	799,692.71	364,017.12
应支付基金管理人的净管理费	566,317.48	243,059.73

注：本基金对持有的基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。

支付基金管理人泰康基金的基金管理费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的基金部分后的余额乘以约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

A 类基金：日基金管理费=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的基金部分后的余额 × （前一日 A 类基金资产净值 / 前一日基金资产净值） × 0.60% / 当年天数

Y 类基金：日基金管理费=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的基金部分后的余额 × （前一日 Y 类基金资产净值 / 前一日基金资产净值） × 0.30% / 当

年天数

本基金本期因投资于基金管理人所管理的其他基金而已在管理费计算基数中扣除部分对应的管理费金额为 309,876.58 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	366,445.03	164,927.92

注：本基金对持有的基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。

支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金部分后的余额的约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

A 类基金：日基金托管费 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金部分后的余额 × （前一日 A 类基金资产净值 / 前一日基金资产净值） × 0.15% / 当年天数

Y 类基金：日基金托管费 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金部分后的余额 × （前一日 Y 类基金资产净值 / 前一日基金资产净值） × 0.075% / 当年天数

本基金本期因投资于基金托管人所托管的其他基金而已在托管费计算基数中扣除部分对应的托管费金额为 52,526.26 元

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

无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	31,147,367.59	64,500.23	9,754,108.48	59,710.43

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本期末，本基金持有基金管理人泰康基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计 236,295,726.07 元，占本基金资产净值的比例为 26.77%。上年度末，本基金持有基金管理人所管理的公开募集证券投资基金合计 33,307,761.67 元，占本基金资产净值的比例为 15.16%。

6.4.10.8.2 当期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

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
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）	149,633.78	28,452.37
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	221,628.81	138,059.64
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	61,817.18	33,725.64

注：当期持有基金产生的应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金的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）、销售服务费等销售费用，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。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

本基金为混合型基金中基金，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金投资的金融工具主要包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金份额、股票、债券和货币市场工具等。本基金在日常经营活动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、市场风险等。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。本基金在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的

国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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持有时间满一年后可随时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 2026 年 06 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》及《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时间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。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基

金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)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发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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/基金销售机构申购、赎回，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，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%。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 2026 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%。

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 2026 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	31,147,367.59	-	-	-	31,147,367.59
结算备付金	2,066,171.35	-	-	-	2,066,171.35
存出保证金	146,426.15	-	-	-	146,426.15
交易性金融资产	47,088,942.52	-	-	762,936,768.72	810,025,711.24
应收申购款	-	-	-	23,172,681.70	23,172,681.70
应收清算款	-	-	-	20,122,932.93	20,122,932.93
其他资产	-	-	-	51,487.37	51,487.37
资产总计	80,448,907.61	-	-	806,283,870.72	886,732,778.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	951,614.31	951,614.31
应付管理人报酬	-	-	-	293,902.46	293,902.46
应付托管费	-	-	-	81,497.27	81,497.27
应付清算款	-	-	-	2,531,688.18	2,531,688.18
应交税费	-	-	-	92,687.42	92,687.42
其他负债	-	-	-	160,242.36	160,242.36
负债总计	-	-	-	4,111,632.00	4,111,632.00
利率敏感度缺口	80,448,907.61	-	-	802,172,238.72	882,621,146.33
上年度末 2025 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	481,901.89	-	-	-	481,901.89
结算备付金	898,426.99	-	-	-	898,426.99
存出保证金	41,402.56	-	-	-	41,402.56
交易性金融资产	12,118,048.76	-	-	188,106,858.91	200,224,907.67
买入返售金融资产	15,996,482.14	-	-	-	15,996,482.14
应收股利	-	-	-	91,268.70	91,268.70
应收申购款	-	-	-	2,361,061.80	2,361,061.80
应收清算款	-	-	-	1,290,268.53	1,290,268.53

其他资产	-	-	-	7,328.70	7,328.70
资产总计	29,536,262.34	-	-	191,856,786.64	221,393,048.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,497,272.27	1,497,272.27
应付管理人报酬	-	-	-	89,614.56	89,614.56
应付托管费	-	-	-	25,303.64	25,303.64
应交税费	-	-	-	7,309.34	7,309.34
其他负债	-	-	-	37,913.91	37,913.91
负债总计	-	-	-	1,657,413.72	1,657,413.72
利率敏感度缺口	29,536,262.34	-	-	190,199,372.92	219,735,635.26

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	市场利率上调 0.25%	-34,373.34	-4,947.89
	市场利率下调 0.25%	34,423.61	4,963.40

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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性

管理，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	28,500,585.44	3.23	1,325,158.72	0.60
交易性金融资产－基金投资	734,436,183.28	83.21	186,781,700.19	85.00
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	762,936,768.72	86.44	188,106,858.91	85.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上涨 5%	60,237,188.12	13,222,993.01
	业绩比较基准下跌 5%	-60,237,188.12	-13,222,993.01

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	762,936,768.72	188,106,858.91
第二层次	47,088,942.52	12,118,048.76
第三层次	-	-
合计	810,025,711.24	200,224,907.67

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。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

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	28,500,585.44	3.21
	其中：股票	28,500,585.44	3.21
2	基金投资	734,436,183.28	82.82
3	固定收益投资	47,088,942.52	5.31
	其中：债券	47,088,942.52	5.31
	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	33,213,538.94	3.75
8	其他各项资产	43,493,528.15	4.90
9	合计	886,732,778.33	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

金额单位：人民币元

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	-	-
C	制造业	24,408,061.43	2.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	870,464.00	0.10
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	2,076,568.01	0.24
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	1,145,492.00	0.13

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	28,500,585.44	3.23

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

金额单位：人民币元

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	300308	中际旭创	2,300	2,921,000.00	0.33
2	688249	晶合集成	34,637	2,044,622.11	0.23
3	688256	寒武纪	1,047	1,670,540.85	0.19
4	688498	源杰科技	771	1,454,106.00	0.16
5	688409	富创精密	4,588	1,405,075.00	0.16
6	300661	圣邦股份	8,200	1,176,536.00	0.13
7	603259	药明康德	9,200	1,145,492.00	0.13
8	688981	中芯国际	6,829	1,084,581.78	0.12
9	300776	帝尔激光	5,000	1,074,800.00	0.12
10	300502	新易盛	1,760	1,068,320.00	0.12
11	301319	唯特偶	5,900	987,247.00	0.11
12	002371	北方华创	1,100	973,016.00	0.11
13	603929	亚翔集成	3,200	870,464.00	0.10
14	601208	东材科技	9,300	658,347.00	0.07
15	688001	华兴源创	6,264	536,824.80	0.06
16	603005	晶方科技	9,300	500,991.00	0.06
17	603986	兆易创新	600	489,000.00	0.06
18	300750	宁德时代	1,200	471,612.00	0.05
19	300401	花园生物	21,400	468,446.00	0.05
20	002824	和胜股份	13,500	466,830.00	0.05
21	688808	联讯仪器	200	464,466.00	0.05
22	688347	华虹宏力	1,271	427,437.30	0.05
23	301338	凯格精机	2,500	407,225.00	0.05
24	688521	芯原股份	1,094	406,027.16	0.05
25	688519	南亚新材	1,056	401,322.24	0.05
26	300408	三环集团	2,400	400,560.00	0.05
27	600183	生益科技	2,300	398,820.00	0.05
28	603179	新泉股份	7,500	372,375.00	0.04

29	688629	华丰科技	1,920	360,019.20	0.04
30	002138	顺络电子	4,600	336,260.00	0.04
31	300243	瑞丰高材	14,800	321,752.00	0.04
32	603757	大元泵业	4,000	303,040.00	0.03
33	000700	模塑科技	20,500	302,580.00	0.03
34	605117	德业股份	2,800	297,304.00	0.03
35	000725	京东方 A	34,000	295,120.00	0.03
36	688025	杰普特	619	290,930.00	0.03
37	601126	四方股份	4,600	290,720.00	0.03
38	002428	云南锗业	2,400	288,432.00	0.03
39	603083	剑桥科技	1,000	254,870.00	0.03
40	300274	阳光电源	1,500	238,530.00	0.03
41	600487	亨通光电	1,600	174,944.00	0.02

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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	5,678,014.48	2.58
2	601939	建设银行	5,158,510.00	2.35
3	688041	海光信息	4,243,585.40	1.93
4	300308	中际旭创	3,975,546.00	1.81
5	688256	寒武纪	3,479,741.61	1.58
6	301216	万凯新材	3,186,205.00	1.45
7	688249	晶合集成	2,147,028.50	0.98
8	002594	比亚迪	2,028,787.00	0.92
9	603393	新天然气	1,990,010.00	0.91
10	603259	药明康德	1,899,210.00	0.86
11	688498	源杰科技	1,753,242.15	0.80
12	688001	华兴源创	1,678,192.62	0.76
13	601899	紫金矿业	1,588,687.00	0.72
14	300567	精测电子	1,573,288.00	0.72
15	600893	航发动力	1,562,710.88	0.71
16	600188	兖矿能源	1,542,186.00	0.70
17	002475	立讯精密	1,514,545.00	0.69
18	688548	广钢气体	1,496,514.58	0.68
19	688545	兴福电子	1,473,893.07	0.67
20	601231	环旭电子	1,388,140.00	0.63

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

（2）“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	5,111,834.00	2.33
2	688981	中芯国际	4,856,956.19	2.21
3	688041	海光信息	4,303,579.77	1.96
4	301216	万凯新材	2,805,086.00	1.28
5	688256	寒武纪	2,199,205.20	1.00
6	002594	比亚迪	2,007,620.00	0.91
7	603393	新天然气	1,764,435.00	0.80
8	300567	精测电子	1,609,613.00	0.73
9	688545	兴福电子	1,580,449.98	0.72
10	688548	广钢气体	1,565,603.40	0.71
11	600893	航发动力	1,541,690.00	0.70
12	601899	紫金矿业	1,483,902.00	0.68
13	002475	立讯精密	1,470,149.00	0.67
14	600188	兖矿能源	1,450,420.10	0.66
15	300308	中际旭创	1,405,260.00	0.64
16	688772	珠海冠宇	1,396,151.96	0.64
17	688001	华兴源创	1,376,691.96	0.63
18	601231	环旭电子	1,374,105.00	0.63
19	301486	致尚科技	1,341,240.00	0.61
20	601857	中国石油	1,322,942.00	0.60

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

（2）“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	139,659,180.56
卖出股票收入（成交）总额	117,111,052.24

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

（2）“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	47,088,942.52	5.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	47,088,942.52	5.34

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	019792	25 国债 19	466,000	47,088,942.52	5.34

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 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金采用目标风险策略，在控制风险的前提下，通过优选各类型公开募集证券投资基金构

建组合，力争获取超越业绩基准的收益，实现养老资产的长期稳健增值。本基金采用目标风险策略，为目标风险系列中相对稳健的产品。结合基金管理人研发的投资决策体系，在控制风险的前提下，对各类资产的配置比例进行战术调整，力争通过基金管理人的主动配置把握各大类资产中长期趋势波动带来的 Beta 收益，获取更优异的风险调整回报。基金管理人将对全市场的主动型基金和被动型基金进行业绩分析、组合分析、费率比较、流动性比较等，权衡主动型基金和被动型基金的相对优势，在权益类、固收类和商品类的内部确定主动和被动的配置比例，并进行动态调整。对于主动管理型基金，基金管理人创立了“以基金经理为核心”的研究体系，覆盖全市场各种风格的基金经理和基金产品，基金将结合对市场风格、结构轮动的判断，选取部分投资风格适合当前市场、评价打分较高的基金经理所管理的基金进行组合投资；在被动指数型基金的筛选上，本基金将首先结合基金管理人对市场结构走势的判断，将适合当前市场的、已开发成基金的指数产品筛选出来，通过综合比较来选择优质的指数基金进行投资。

股票投资上，本 FOF 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，精选具有较高投资价值的上市公司，进行股票的选择与组合优化。同时，本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，投资于债券资产。债券投资策略包括：久期管理策略；期限结构配置策略；骑乘策略；息差策略；信用策略；个券精选策略；证券公司短期公司债券投资策略；可转换债券投资策略等。

本基金为混合型基金中基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

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	009344	泰康长江经济带债券 C	契约型开放式	93,013,463.70	101,635,811.78	11.52	是
2	019483	泰康信用精选债券 E	契约型开放式	81,734,492.48	95,514,927.91	10.82	是

3	511360	短融 ETF 海富通	交易型开放式(ETF)	542,500.00	61,633,425.00	6.98	否
4	022155	交银裕隆纯债债券 D	契约型开放式	40,084,873.88	50,306,516.72	5.70	否
5	019775	长城稳健增利债券 D	契约型开放式	40,801,256.59	50,120,263.60	5.68	否
6	003290	长城久稳债券 A	契约型开放式	38,795,366.56	45,056,938.72	5.10	否
7	003280	鹏华丰恒债券 A	契约型开放式	36,638,982.03	39,995,112.78	4.53	否
8	512050	A500ETF 华夏	交易型开放式(ETF)	15,696,800.00	21,018,015.20	2.38	否
9	020082	易方达信用债债券 D	契约型开放式	17,803,993.99	20,143,438.80	2.28	否
10	008409	景顺长城景泰裕利纯债债券 A	契约型开放式	17,801,382.52	20,046,136.86	2.27	否
11	024671	泰康安惠纯债债券 D	契约型开放式	16,227,180.53	20,009,736.31	2.27	是
12	159352	A500ETF 南方	交易型开放式(ETF)	14,028,800.00	19,654,348.80	2.23	否
13	002529	泰康安	契约	18,552,695.43	19,135,250.07	2.17	是

		益纯债 C	型开放式				
14	510500	中证 500ETF 南方	交易型开放式(ETF)	1,601,500.00	14,724,191.00	1.67	否
15	159922	中证 500ETF 嘉实	交易型开放式(ETF)	3,631,400.00	13,290,924.00	1.51	否
16	563360	A500ETF 华泰柏瑞	交易型开放式(ETF)	8,867,400.00	12,600,575.40	1.43	否
17	512480	半导体 ETF 国联安	交易型开放式(ETF)	3,453,300.00	10,377,166.50	1.18	否
18	025477	长城稳健增利债券 F	契约型开放式	8,228,952.35	10,036,030.29	1.14	否
19	019638	金鹰添瑞中短债 D	契约型开放式	9,138,183.15	10,000,827.64	1.13	否
20	015991	长城鑫利 30 天滚动持有中短债 A	契约型开放式	9,000,000.00	10,000,800.00	1.13	否
21	588380	科创创业 ETF 富国	交易型开放式(ETF)	5,593,100.00	8,384,056.90	0.95	否
22	000032	易方达信用债债券 A	契约型开放式	5,891,335.86	6,658,976.92	0.75	否

23	159780	科创创业50ETF南方	交易型开放式(ETF)	4,406,368.00	6,464,141.86	0.73	否
24	512100	中证1000ETF南方	交易型开放式(ETF)	1,737,600.00	6,215,395.20	0.70	否
25	159845	中证1000ETF华夏	交易型开放式(ETF)	1,697,900.00	6,199,032.90	0.70	否
26	515880	通信ETF国泰	交易型开放式(ETF)	2,883,800.00	5,179,304.80	0.59	否
27	159655	标普500ETF华夏	交易型开放式(ETF)	2,584,200.00	4,871,217.00	0.55	否
28	159583	通信ETF富国	交易型开放式(ETF)	2,048,800.00	4,310,675.20	0.49	否
29	511130	30年国债ETF博时	交易型开放式(ETF)	37,500.00	3,989,287.50	0.45	否
30	015947	兴业研究精选混合C	契约型开放式	1,439,819.05	3,900,325.82	0.44	否
31	018731	华夏招鑫鸿瑞混合C	契约型开放式	1,252,308.66	3,625,809.26	0.41	否
32	001515	平安新鑫先锋C	契约型开放式	768,901.02	2,878,765.42	0.33	否

33	159338	中证 A500ETF 国泰	交易型开放式(ETF)	1,562,100.00	2,099,462.40	0.24	否
34	511090	30 年国债 ETF 鹏扬	交易型开放式(ETF)	17,100.00	1,997,570.70	0.23	否
35	159952	创业板 ETF 广发	交易型开放式(ETF)	682,400.00	1,808,360.00	0.20	否
36	014061	浦银新兴产业混合 C	契约型开放式	345,485.50	1,520,101.65	0.17	否
37	562800	稀有金属 ETF 嘉实	交易型开放式(ETF)	1,272,700.00	1,453,423.40	0.16	否
38	018036	长城全球新能源车股票发起式(QDII)C	契约型开放式	446,428.85	1,372,545.50	0.16	否
39	515050	通信 ETF 华夏	交易型开放式(ETF)	808,700.00	1,129,753.90	0.13	否
40	159783	科创创业 50ETF 华夏	交易型开放式(ETF)	741,100.00	1,098,310.20	0.12	否
41	560780	半导体设备 ETF 广发	交易型开放式(ETF)	739,800.00	1,082,327.40	0.12	否

42	017533	平安研究优选混合 C	契约型开放式	541,052.35	1,035,357.78	0.12	否
43	159915	创业板 ETF 易方达	交易型开放式(ETF)	224,900.00	981,463.60	0.11	否
44	159516	半导体设备 ETF 国泰	交易型开放式(ETF)	489,900.00	967,552.50	0.11	否
45	001959	华商乐享互联灵活配置混合 A	契约型开放式	296,149.77	895,853.05	0.10	否
46	159781	科创创业 ETF 易方达	交易型开放式(ETF)	592,800.00	874,972.80	0.10	否
47	011371	华商远见价值 A	契约型开放式	942,473.93	845,870.35	0.10	否
48	008984	财通科技创新混合 C	契约型开放式	336,190.96	822,491.18	0.09	否
49	588200	科创芯片 ETF 嘉实	交易型开放式(ETF)	165,900.00	818,882.40	0.09	否
50	159813	半导体 ETF 鹏华	交易型开放式(ETF)	375,700.00	810,009.20	0.09	否
51	159570	港股通创新药 ETF 汇	交易型开放式	620,100.00	780,705.90	0.09	否

		添富	(ETF)				
52	003823	中信建投轮换混合 C	契约型开放式	238,486.49	742,050.71	0.08	否
53	512510	中证 500ETF 华泰柏瑞	交易型开放式 (ETF)	246,400.00	660,352.00	0.07	否
54	159994	通信 ETF 银华	交易型开放式 (ETF)	358,400.00	612,147.20	0.07	否
55	513650	标普 500ETF 南方	交易型开放式 (ETF)	282,000.00	526,776.00	0.06	否
56	159608	稀有金属 ETF 广发	交易型开放式 (ETF)	343,100.00	450,147.20	0.05	否
57	159997	电子 ETF 天弘	交易型开放式 (ETF)	143,000.00	409,552.00	0.05	否
58	512500	中证 500ETF 华夏	交易型开放式 (ETF)	73,300.00	374,563.00	0.04	否
59	159949	创业板 50ETF 华安	交易型开放式 (ETF)	127,700.00	266,637.60	0.03	否
60	159977	创业板 ETF 天弘	交易型开放式 (ETF)	9,500.00	21,517.50	0.00	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.13.2 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约定备选股票库之外的股票。

7.13.3 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	146,426.15
2	应收清算款	20,122,932.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,172,681.70
6	其他应收款	51,487.37
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,493,528.15

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 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。

7.13.6 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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	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（%）	持有份额	占总份额比例（%）
泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A	1,878	424,084.44	19,273,620.08	2.42	777,156,961.89	97.58
泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）Y	558	2,509.65	0.00	0.00	1,400,387.17	100.00
合计	2,431	328,190.44	19,273,620.08	2.42	778,557,349.06	97.58

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	99.72

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A	106,371.12	0.0134
	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）Y	22,346.23	1.5957
	合计	128,717.35	0.0161

8.4 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	份额级别	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	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A	0
	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）Y	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A	10~50
	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）Y	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）A	泰康福安稳健养老目标一年持有混合（FOF）Y
基金合同生效日（2021 年 7 月 20 日）基金份额总额	1,042,398,621.21	-
本报告期期初基金份额总额	206,702,353.17	1,042,303.92
本报告期基金总申购份额	613,222,120.55	427,743.15
减：本报告期基金总赎回份额	23,493,891.75	69,659.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	796,430,581.97	1,400,387.17

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

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 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。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	元数量	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(%)	
中信证券	3	256,770,232.80	100.00	111,928.55	100.00	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	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	-	-	-	-	-
国联民生证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国泰海通证券	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	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	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	-	-	-	-	-

中信建投证券	2	-	-	-	-	-
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、本报告期内本基金租用券商交易单元变更情况：无。

10.8.2 基金租用或者通过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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)

						例(%)		
中信证券	68,198,537.00	100.00	1,087,000,000.00	100.00	-	-	1,907,607,266.98	100.00
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
野村证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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基金持有停牌股票估值调整的公告	《中国证券报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 01 月 12 日
2	泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）2025 年第四季度报告	《中国证券报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 01 月 21 日
3	泰康基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	《中国证券报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 01 月 23 日
4	泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）2025 年年	《中国证券报》;中国证监会基金电子披露网	2026 年 03 月 30 日

	度报告	站及基金管理人网站	
5	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	《中国证券报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 03 月 31 日
6	泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）2026 年第一季度报告	《中国证券报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 04 月 21 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

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。

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福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的文件；

（二）《泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

（三）《泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》；

（四）《泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；

（五）《泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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（《中国证券报》）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

2026 年 8 月 28 日