

# 泰康稳健双利债券型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 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 2024 年 10 月 23 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 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	泰康稳健双利债券
基金主代码	020862
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 5 月 31 日
报告期末基金份额总额	3,604,162,716.70 份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过合理配置大类资产和精选投资标的，力求实现基金资产的长期稳健增值，为投资者提供稳健的长期投资工具。
投资策略	<p>本基金在严格控制风险的基础上，通过合理配置大类资产和精选投资标的，力求实现基金资产的长期稳健增值。在具体投资上通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。</p> <p>在大类资产配置上，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>在债券投资上，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，运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略、信用策略、个券精选策略等策略进行投</p>

	<p>资。在可转换债券和可交换债券投资策略方面，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。</p> <p>在资产支持证券投资上，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。</p> <p>在股票投资上，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。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，在定性分析的同时结合量化分析方法，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，以此构建股票组合。本基金通过对国内 A 股和港股通标的股票的跨市场投资，来达到分散投资风险、增强基金整体收益的目的。</p> <p>在证券投资基金投资上，本基金将通过基金评价研究机构推荐、量化指标筛选打分等一种或多种方法，进行初步分析，获得候选基金池。在候选基金池范围内，从多维度对待选投资标的的进行定性分析，并做出最终的投资决策。</p> <p>在国债期货投资上，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根据风险管理原则，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，以达到降低投资组合的整体风险的目的。在信用衍生品投资上，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。</p>
业绩比较基准	中债新综合全价（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*12%+恒生指数收益率*3%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%

风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险水平高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 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	泰康稳健双利债券 A	泰康稳健双利债券 C
下属分级基金的交易代码	020862	020863
报告期末下属分级基金的份额总额	417,742,421.75 份	3,186,420,294.95 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	泰康稳健双利债券 A	泰康稳健双利债券 C
1. 本期已实现收益	1,988,676.02	15,510,740.27
2. 本期利润	3,895,822.35	29,162,944.46
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0069	0.0053
4. 期末基金资产净值	421,889,395.11	3,214,267,216.54
5. 期末基金份额净值	1.0099	1.0087

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）本基金合同生效日为 2024 年 5 月 31 日，截止报告期末本基金未满一年。

#### 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

泰康稳健双利债券 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	①—③	②—④
----	--------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

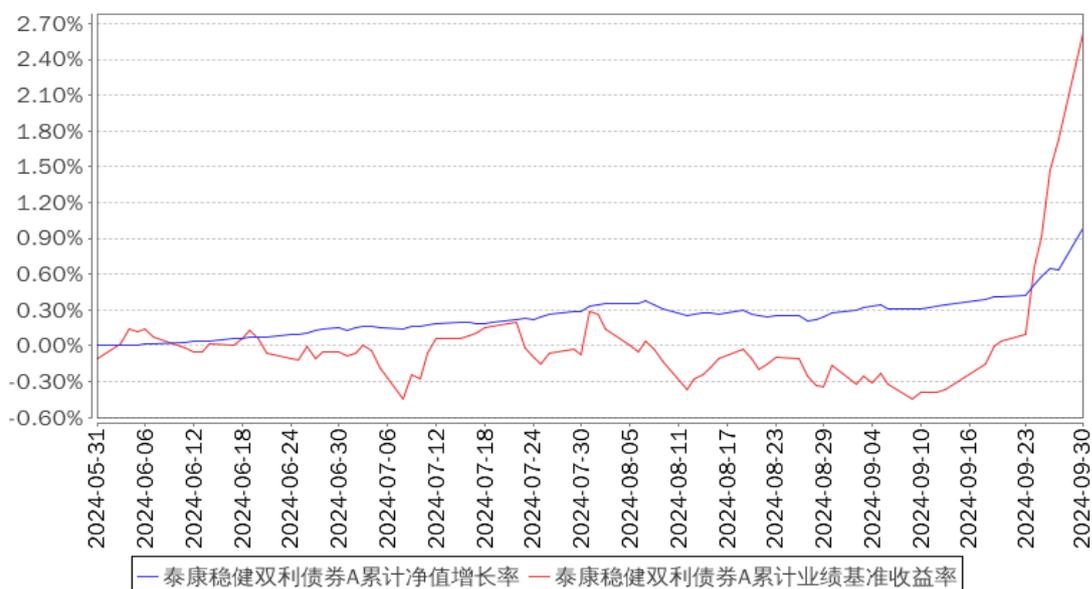
				准差④		
过去三个月	0.84%	0.05%	2.67%	0.19%	-1.83%	-0.14%
自基金合同 生效起至今	0.99%	0.04%	2.62%	0.17%	-1.63%	-0.13%

泰康稳健双利债券 C

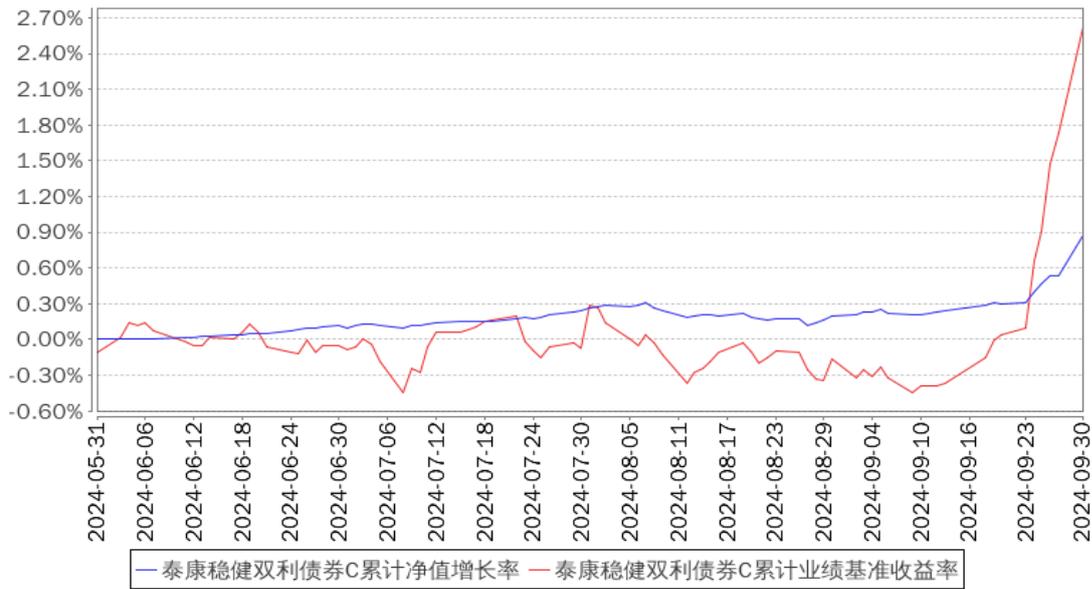
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.75%	0.05%	2.67%	0.19%	-1.92%	-0.14%
自基金合同 生效起至今	0.87%	0.04%	2.62%	0.17%	-1.75%	-0.13%

### 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

泰康稳健双利债券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



泰康稳健双利债券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 2024 年 05 月 31 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，截止报告期末本基金未过建仓期。

### 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	2024年5月31日	-	16年	蒋利娟于 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 日至今担任泰康新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

				<p>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。</p>
--	--	--	--	---

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，三季度延续了弱势运行、结构分化的特征。偏需求侧的消费增速表现较为疲弱，M2 和社融等金融指标继续下行，通胀维持低位，整体有所承压。9 月底的一揽子政策和政治局会议一定程度上扭转了低迷的市场预期，提振了信心，后续关注政策如何落地、以及经济企稳的可能。

债券市场方面，收益率先是震荡下行，在 9 月底出现了较为快速的抬升。央行买短卖长的操作，在给市场提供流动性支撑的同时，也一定程度上减缓了长端利率下行的节奏；但在经济需求不足和资产荒的背景下，利率总体趋势向下。在 9 月底的预期扭转之后，资产再平衡的行为在短期演绎得较为剧烈，利率有所回调。

由于基金仍处于建仓期，因此陆续配置各类资产。固收投资策略上，在利率债方面，根据市场形势调节仓位和久期；在信用债方面，由于信用利差较低，因此信用债配置上，重点配置中短期品种。

权益操作方面，随着基金净值的增长可承受波动能力提高后，结合权益市场的变化，报告期内适当增加含权类资产的仓位，包括股票、股票 ETF 等。

#### 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 1.0099 元，本报告期基金 A 份额净值增长率为 0.84%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.0087 元，本报告期基金 C 份额净值增长率为 0.75%；同期业绩比较基准增长率为 2.67%。

#### 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	95,808,352.00	1.90
	其中：股票	95,808,352.00	1.90
2	基金投资	111,006,407.30	2.20
3	固定收益投资	4,761,917,264.25	94.44
	其中：债券	4,761,917,264.25	94.44
	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	67,579,718.11	1.34
8	其他资产	5,749,793.35	0.11
9	合计	5,042,061,535.01	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 13,734,720.00 元，占期末资产净值比例为 0.38%。

## 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	20,511,233.00	0.56
C	制造业	32,992,071.00	0.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,991,962.00	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,917,128.00	0.14
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	-	-
J	金融业	13,457,475.00	0.37
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,864,359.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	4,339,404.00	0.12
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	82,073,632.00	2.26

### 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	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	6,681,920.00	0.18
E 金融	3,427,600.00	0.09
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	3,625,200.00	0.10
K 房地产	-	-
合计	13,734,720.00	0.38

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	600988	赤峰黄金	578,700	11,672,379.00	0.32
2	001289	龙源电力	237,900	3,991,962.00	0.11
2	00916	龙源电力	570,000	3,625,200.00	0.10
3	01398	工商银行	820,000	3,427,600.00	0.09
3	601398	工商银行	541,000	3,343,380.00	0.09
4	00639	首钢资源	2,512,000	6,681,920.00	0.18
5	601699	潞安环能	319,000	5,630,350.00	0.15
6	601939	建设银行	522,700	4,145,011.00	0.11
7	601636	旗滨集团	649,100	4,134,767.00	0.11
8	002142	宁波银行	160,600	4,127,420.00	0.11
9	600887	伊利股份	123,800	3,598,866.00	0.10
10	603939	益丰药房	114,800	2,929,696.00	0.08

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	460,386,268.78	12.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,525,162,480.33	41.94
	其中：政策性金融债	194,910,184.95	5.36
4	企业债券	10,199,785.75	0.28
5	企业短期融资券	1,418,537,220.76	39.01
6	中期票据	968,709,041.52	26.64
7	可转债（可交换债）	82,753,639.14	2.28
8	同业存单	296,168,827.97	8.15
9	其他	-	-
10	合计	4,761,917,264.25	130.96

### 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	2228016	22 华夏银行 01	2,900,000	295,550,409.32	8.13
2	230026	23 附息国债 26	2,100,000	220,806,497.28	6.07
3	180401	18 农发 01	1,700,000	177,681,491.80	4.89
4	012481597	24 鲁高速 SCP002	1,300,000	130,685,709.04	3.59
5	232380021	23 浙商银行二 级资本债 01	1,100,000	115,126,753.42	3.17

### 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

根据风险管理原则，本基金以套期保值为主要目的进行国债期货投资。通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现券资产进行匹配，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组

合的整体风险的目的。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-3,744,694.60
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

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

## 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

浙商银行股份有限公司因向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押评估费等原因在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局浙江监管局的公开处罚。

中国银行股份有限公司因部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求等原因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；因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查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；因代理销售保险夸大保险责任、承诺收益等欺骗投保人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；因违反账户管理规定等原因在本报告编制前一年内受到中国人民银行的公开处罚与公开批评。

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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	59,477.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,690,315.75
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,749,793.35

#### 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	113062	常银转债	4,202,984.96	0.12
2	113661	福 22 转债	4,170,582.19	0.11
3	113579	健友转债	3,853,419.00	0.11
4	123115	捷捷转债	3,738,325.02	0.10
5	123150	九强转债	3,511,968.18	0.10
6	110090	爱迪转债	3,483,336.54	0.10
7	118025	奕瑞转债	3,096,688.58	0.09
8	118034	晶能转债	2,790,696.65	0.08
9	113644	艾迪转债	2,743,372.34	0.08
10	113047	旗滨转债	2,679,360.11	0.07
11	127085	韵达转债	2,632,360.11	0.07
12	110076	华海转债	2,420,646.11	0.07
13	123174	精锻转债	2,151,997.26	0.06
14	111010	立昂转债	2,134,219.04	0.06
15	127038	国微转债	2,048,427.12	0.06
16	123107	温氏转债	1,994,082.41	0.05
17	110085	通 22 转债	1,837,127.52	0.05
18	113675	新 23 转债	1,806,838.36	0.05
19	127045	牧原转债	1,685,326.27	0.05
20	123121	帝尔转债	1,660,461.58	0.05
21	123119	康泰转 2	1,583,884.24	0.04
22	123169	正海转债	1,393,905.95	0.04
23	113655	欧 22 转债	1,383,914.11	0.04
24	123210	信服转债	1,362,372.22	0.04
25	127072	博实转债	1,282,625.19	0.04
26	127030	盛虹转债	1,238,979.41	0.03
27	113044	大秦转债	1,187,580.55	0.03
28	113641	华友转债	1,145,408.00	0.03
29	113043	财通转债	1,116,473.00	0.03
30	110089	兴发转债	1,109,197.26	0.03
31	113052	兴业转债	1,106,633.68	0.03

32	127073	天赐转债	1,102,249.85	0.03
33	123090	三诺转债	1,099,665.39	0.03
34	113652	伟 22 转债	1,097,126.47	0.03
35	113042	上银转债	1,096,198.54	0.03
36	123064	万孚转债	1,093,222.48	0.03
37	110082	宏发转债	1,079,162.30	0.03
38	123117	健帆转债	1,068,494.43	0.03
39	118031	天 23 转债	856,120.55	0.02
40	118033	华特转债	850,320.12	0.02
41	127069	小熊转债	735,684.93	0.02
42	111002	特纸转债	715,325.75	0.02
43	128121	宏川转债	625,979.01	0.02
44	128137	洁美转债	575,541.10	0.02
45	128081	海亮转债	559,493.97	0.02
46	113682	益丰转债	552,693.70	0.02

#### 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 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	588000	华夏上证科创板 50 成份 ETF	交易型开放式(ETF)	21,470,800.00	20,397,260.00	0.56	否
2	515180	易方达中证红利 ETF	交易型开放式(ETF)	12,076,500.00	17,776,608.00	0.49	否
3	159915	创业板 ETF	交易型开放式(ETF)	7,179,800.00	16,025,313.60	0.44	否
4	512170	华宝中证医疗 ETF	交易型开放式(ETF)	41,442,600.00	14,587,795.20	0.40	否

5	515220	国泰中证煤炭 ETF	交易型开放式(ETF)	9,252,500.00	12,157,785.00	0.33	否
6	512100	南方中证1000ETF	交易型开放式(ETF)	4,916,200.00	11,744,801.80	0.32	否
7	515100	景顺长城中证红利低波动100ETF	交易型开放式(ETF)	3,632,300.00	5,379,436.30	0.15	否
8	512010	易方达沪深300医药ETF	交易型开放式(ETF)	10,807,600.00	4,312,232.40	0.12	否
9	512480	国联安中证全指半导体ETF	交易型开放式(ETF)	5,106,400.00	4,054,481.60	0.11	否
10	588080	易方达上证科创板50ETF	交易型开放式(ETF)	2,526,500.00	2,309,221.00	0.06	否

注：本基金为债券型基金，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 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 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）	33,184.65	29.76
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	7,126.45	3.72

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。

### 6.3 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	泰康稳健双利债券 A	泰康稳健双利债券 C
报告期期初基金份额总额	612,492,890.15	7,387,835,114.57
报告期期间基金总申购份额	5,786,429.91	65,022,597.24
减：报告期期间基金总赎回份额	200,536,898.31	4,266,437,416.86
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	417,742,421.75	3,186,420,294.95

注：（1）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。

（2）本基金合同生效日为 2024 年 5 月 31 日，截止报告期末本基金未满一年。

## §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

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。

### 8.2 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。

## §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稳健双利债券型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康稳健双利债券型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康稳健双利债券型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康稳健双利债券型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康稳健双利债券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

2024 年 10 月 24 日