# 泰康裕泰债券型证券投资基金
# 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 23 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 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 | 泰康裕泰债券 |
| 基金主代码 | 006207 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 3 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,735,786,471.83 份 |
| 投资目标 | 本基金在合理控制风险的基础上，通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 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型分析手段，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。<br>债券投资方面，本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。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，形成对债券收益率曲线形态及其发展趋势的判断。信用策略方面，利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估，重点分析发债主体的行业发展前景、市场地位、公司治理、财务质量、融资目 |

| | | |
|---|---|---|
| | 的等要素，综合评价其信用等级，分析违约风险以及合理信用利差水平，识别投资价值。<br>股票投资方面，本基金在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，将结合市场环境运用多种投资策略，多维度分析股票的投资价值，充分挖掘市场中潜在的投资机会。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。 | |
| 业绩比较基准 | 中债新综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*5%+恒生指数收益率*5%+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，属于较低风险品种，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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 | 泰康裕泰债券 A | 泰康裕泰债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006207 | 006208 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,264,043,044.61 份 | 2,471,743,427.22 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 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 泰康裕泰债券 A | 泰康裕泰债券 C |
| 1.本期已实现收益 | 6,431,437.85 | 13,960,712.65 |
| 2.本期利润 | 21,237,241.27 | 45,847,232.55 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0207 | 0.0194 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,428,762,921.72 | 2,781,824,602.44 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1303 | 1.1255 |

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

泰康裕泰债券 A

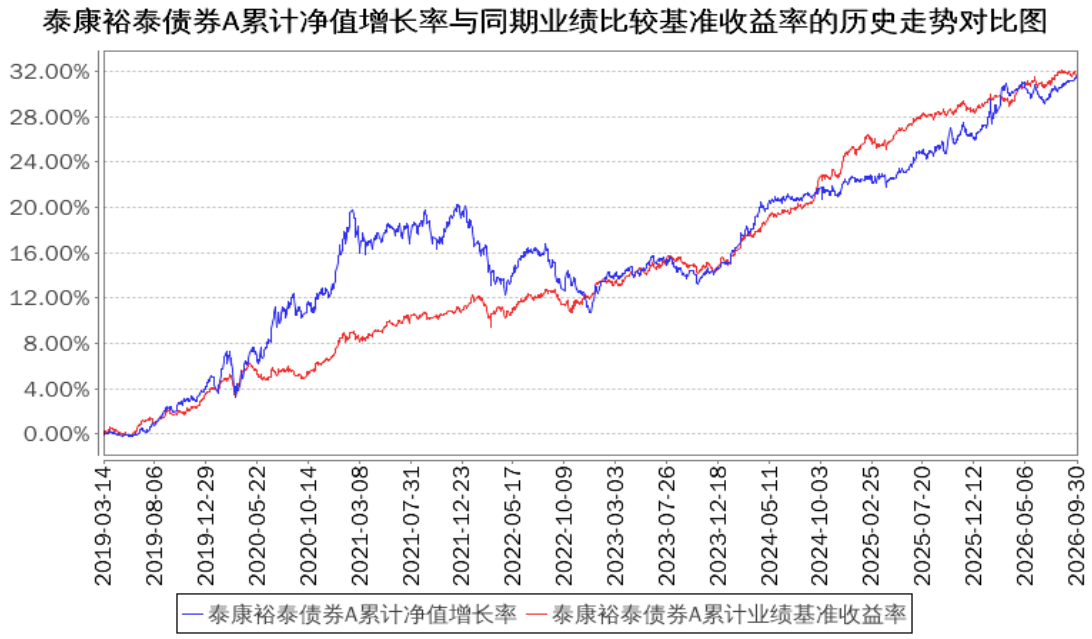
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.88% | 0.09% | 0.65% | 0.09% | 1.23% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.12% | 0.11% | 1.87% | 0.11% | -0.75% | 0.00% |
| 过去一年 | 4.52% | 0.19% | 2.50% | 0.11% | 2.02% | 0.08% |
| 过去三年 | 15.01% | 0.17% | 14.61% | 0.11% | 0.40% | 0.06% |
| 过去五年 | 12.04% | 0.19% | 19.37% | 0.12% | -7.33% | 0.07% |
| 过去七年 | 28.98% | 0.23% | 29.50% | 0.12% | -0.52% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 31.57% | 0.22% | 31.66% | 0.12% | -0.09% | 0.10% |

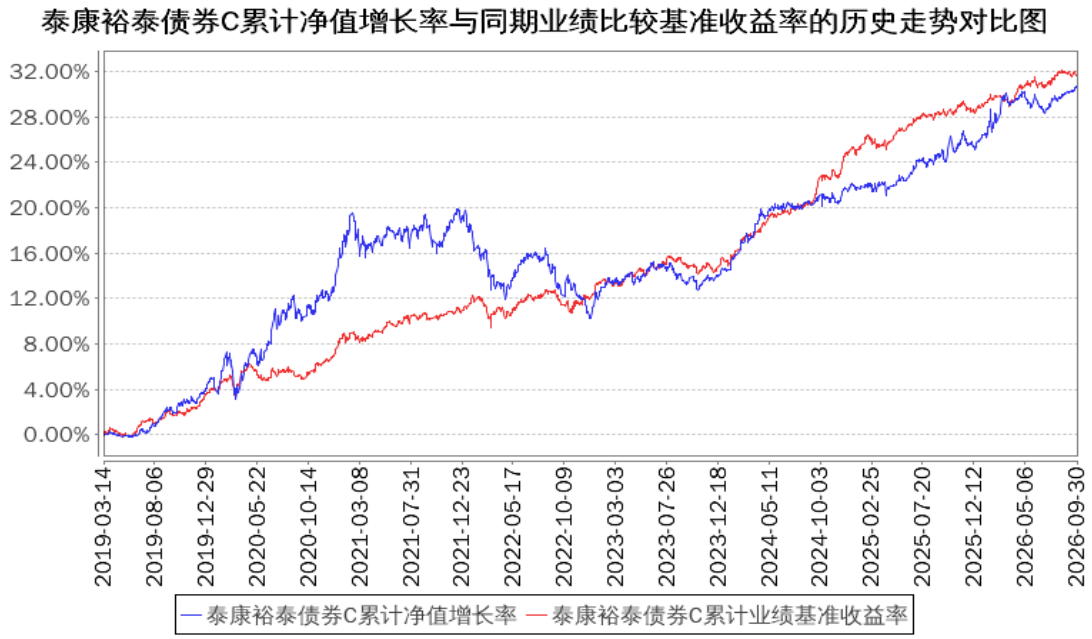
泰康裕泰债券 C

| 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 | 1.86% | 0.09% | 0.65% | 0.09% | 1.21% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.07% | 0.11% | 1.87% | 0.11% | -0.80% | 0.00% |
| 过去一年 | 4.42% | 0.19% | 2.50% | 0.11% | 1.92% | 0.08% |
| 过去三年 | 14.76% | 0.17% | 14.61% | 0.11% | 0.15% | 0.06% |
| 过去五年 | 11.57% | 0.19% | 19.37% | 0.12% | -7.80% | 0.07% |
| 过去七年 | 28.17% | 0.23% | 29.50% | 0.12% | -1.33% | 0.11% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效起至今 | 30.67% | 0.22% | 31.66% | 0.12% | -0.99% | 0.10% |

### 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 2019 年 03 月 14 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 | | |
| 任翀 | 本基金基金经理 | 2019 年 3 月 14 日 | - | 18 年 | 任翀，硕士研究生。2015 年 7 月加入泰康公募，现任泰康基金固定收益基金经理。曾任安永华明会计师事务所高级审计员、中国银行总行金融市场部投资经理、安信基金固定收益部总经理助理等职务。2016 年 3 月 23 日至今担任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 30 日至今担任泰康安益纯债债券型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 26 日至今担任泰康安惠纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 1 日至今担任泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 27 日至 2023 年 12 月 12 日担任泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金基金经理。2019 年 3 月 14 日至今担任泰康裕泰债券型证券投资基金基金经理。2019 年 5 月 27 日至 2021 年 5 月 7 日担任泰康安业政策性金融债债券型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 17 日至 2024 年 1 月 12 日担任泰康安欣纯债债券型证券投资基金基金经理。2024 年 2 月 28 日至今担任泰康悦享 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理。2024 年 8 月 1 日至今担任泰康悦享 60 天持有期债券型证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 1 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。2025 年 9 月 29 日至今担任泰康悦享 180 天持有期债券型证券投资基金基金经理。2026 年 7 月 17 日至今担任泰康裕成债券型证券投资基金基金经理。 |
| 马敦超 | 本基金基金经理 | 2024 年 1 月 5 日 | - | 11 年 | 马敦超，博士研究生。2022 年 5 月加入泰康公募，现任泰康基金股票基金经理。曾任中粮集团营养健康研究院战略与市场研究部管理专员、哈纳斯新能源 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 集团发展规划部业务总监、阳光资产管理股份有限公司权益投资一部高级投资经理等职务。2022 年 10 月 14 日至今担任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。2022 年 10 月 14 日至 2025 年 6 月 26 日担任泰康申润一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2024 年 1 月 5 日至今担任泰康裕泰债券型证券投资基金基金经理。2025 年 8 月 6 日至今担任泰康恒泰回报灵活配置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。

固收投资上，我们在 2026 年三季度大部分时间保持了较高的久期，主要基于宽松的资金面和陡峭的收益率曲线。持仓以利率债和高等级信用债为主，严格防范信用风险，同时超长债波段交易增厚组合收益。转债估值较高，整体保持较低仓位。

权益市场方面，三季度权益市场承压，风格上有所收敛，价值相对偏强，成长相对偏弱。在权益操作上，我们在三季度继续维持较低的权益仓位，在持仓结构上，我们大幅减持了前期重仓的煤炭股，主要原因是煤价过快上涨的现象难于持续，但我们依然认为煤炭行业处于景气复苏的上半场，后续我们将继续紧密关注好的投资时机。同时，我们买入较多的中小银行股和安全边际的消费龙头股，买入前者是因为它们的业绩稳健和股息率较高，买入后者是因为它们的股价位置低、良好的资产负债表和可观的股息率。当前全球经济体逐渐回到加息通道，持续两年的全球牛市逐渐面临一定的估值压力和增长压力，投资胜率逐渐会成为决定投资回报的关键因素，而低估值是决定投资胜率的关键因素。目前产品持仓多是估值低位的传统行业股票，赔率和胜率均有一定的空间。

## 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 1.1303 元,本报告期基金 A 份额净值增长率为 1.88%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.1255 元,本报告期基金 C 份额净值增长率为 1.86%；同期业绩比较基准增长率为 0.65%。

## 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 | 366,746,707.18 | 8.70 |
| | 其中：股票 | 366,746,707.18 | 8.70 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,643,086,298.48 | 86.38 |
| | 其中：债券 | 3,643,086,298.48 | 86.38 |
| | 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 | 167,006,607.79 | 3.96 |
| | 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 | 10,071,273.83 | 0.24 |
| 8 | 其他资产 | 30,734,223.54 | 0.73 |
| 9 | 合计 | 4,217,645,110.82 | 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 2,592,200.00 元，占期末资产净值比例为 0.06%。

## 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 | 30,409,656.00 | 0.72 |
| C | 制造业 | 63,486,176.46 | 1.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 133,455,705.00 | 3.17 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 业 | | |
| J | 金融业 | 126,005,525.72 | 2.99 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 10,797,444.00 | 0.26 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 364,154,507.18 | 8.65 |

### 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 | 2,592,200.00 | 0.06 |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | - | - |
| H 信息技术 | - | - |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 2,592,200.00 | 0.06 |

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 | 600900 | 长江电力 | 2,495,800 | 71,230,132.00 | 1.69 |
| 2 | 601328 | 交通银行 | 4,683,900 | 36,300,225.00 | 0.86 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 3,057,100 | 25,312,788.00 | 0.60 |
| 4 | 600795 | 国电电力 | 4,042,800 | 21,588,552.00 | 0.51 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 482,900 | 18,485,412.00 | 0.44 |
| 6 | 601985 | 中国核电 | 1,843,100 | 16,716,917.00 | 0.40 |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 331,400 | 15,840,920.00 | 0.38 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 855,400 | 15,439,970.00 | 0.37 |
| 9 | 600674 | 川投能源 | 825,500 | 13,719,810.00 | 0.33 |
| 10 | 601229 | 上海银行 | 1,302,600 | 12,700,350.00 | 0.30 |

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 | 519,991,988.17 | 12.35 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,813,609,504.69 | 66.82 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,216,017,745.21 | 28.88 |
| 4 | 企业债券 | 103,560,124.00 | 2.46 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,055,476.71 | 0.24 |
| 6 | 中期票据 | 146,412,213.15 | 3.48 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 49,456,991.76 | 1.17 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,643,086,298.48 | 86.52 |

## 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 | 230203 | 23 国开 03 | 2,500,000 | 259,242,739.73 | 6.16 |
| 2 | 2128032 | 21 兴业银行二级 01 | 2,300,000 | 238,584,822.47 | 5.67 |
| 3 | 2600006 | 26 超长特别国债 06 | 2,300,000 | 232,652,625.00 | 5.53 |
| 4 | 09250412 | 25 农发清发 12 | 1,700,000 | 171,489,945.21 | 4.07 |
| 5 | 230208 | 23 国开 08 | 1,600,000 | 164,369,008.22 | 3.90 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的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

兴业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，特定重大事项披露违规在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局上海监管局的公开处罚。

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。

中国建设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国家外汇管理局北京市分局的公开处罚、公开批评；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上海监管局的公开处罚。

中国进出口银行因未依法履行相关职责在本报告编制前一年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外汇管理局北京市分局的公开处罚。

中国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金融监督管理总局的公开处罚。

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

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 | 204,002.70 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 105,542.40 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 30,424,678.44 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 30,734,223.54 |

### 5.10.4 报告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。

### 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

| 项目 | 泰康裕泰债券 A | 泰康裕泰债券 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 921,198,780.45 | 1,925,310,045.48 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 549,832,243.23 | 1,692,111,698.16 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 206,987,979.07 | 1,145,678,316.42 |
| 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 | 1,264,043,044.61 | 2,471,743,427.22 |

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 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予泰康裕泰债券型证券投资基金注册的文件；

（二）《泰康裕泰债券型证券投资基金基金合同》；

（三）《泰康裕泰债券型证券投资基金招募说明书》；

（四）《泰康裕泰债券型证券投资基金托管协议》；

（五）《泰康裕泰债券型证券投资基金产品资料概要》。

### 9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《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 10 月 23 日**