

泰康景泰回报混合型证券投资基金

2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 19 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 18 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 1 月 1 日起至 2024 年 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 泰康景泰回报混合 |
| 基金主代码 | 005014 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 12 月 13 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 725,295,111.47 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过合理配置大类资产和精选投资标的，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。 |
| 投资策略 | <p>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>本基金将利用基金管理人多年来在宏观经济分析上的丰富经验和积累，通过基金管理人自身研发构建的固定收益投资决策分析体系（FIFAM 系统）和权益投资决策分析体系（MVPCT 系统）定期评估宏观经济和投资环境，并对全球及国内经济发展进行评估和展望，分别预测股票和债券类资产未来的收益和风险，综合以上分析结果，拟定资产配置方案。</p> <p>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，</p> |

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| | <p>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。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。本基金将重点分析发债主体的行业展前景、市场地位、公司治理、财务质量、融资目的等要素，综合评定信用等级，对债券重新定价。</p> <p>股票投资方面，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，以此构建股票组合。</p> | |
| 业绩比较基准 | 中债新综合财富（总值）指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*20%+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。 | |
| 基金管理人 | 泰康基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 泰康景泰回报混合 A | 泰康景泰回报混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005014 | 005015 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 666,812,312.84 份 | 58,482,798.63 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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 泰康景泰回报混合 A | 泰康景泰回报混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 6,806,103.78 | 517,287.68 |
| 2. 本期利润 | 16,796,776.48 | 1,224,644.32 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0228 | 0.0219 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,086,093,335.30 | 93,825,944.92 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.6288 | 1.6043 |

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

泰康景泰回报混合 A

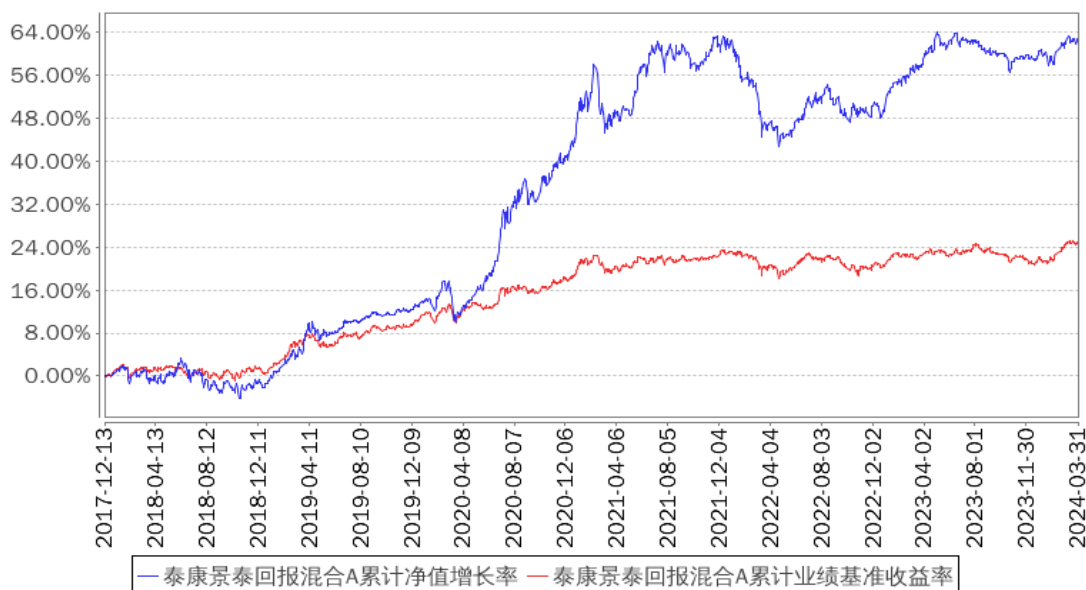
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.47% | 0.30% | 2.16% | 0.20% | -0.69% | 0.10% |
| 过去六个月 | 1.71% | 0.26% | 1.78% | 0.18% | -0.07% | 0.08% |
| 过去一年 | 2.42% | 0.27% | 1.75% | 0.18% | 0.67% | 0.09% |
| 过去三年 | 9.79% | 0.40% | 4.15% | 0.21% | 5.64% | 0.19% |
| 过去五年 | 52.75% | 0.46% | 16.77% | 0.23% | 35.98% | 0.23% |
| 自基金合同 生效起至今 | 62.88% | 0.46% | 24.85% | 0.24% | 38.03% | 0.22% |

泰康景泰回报混合 C

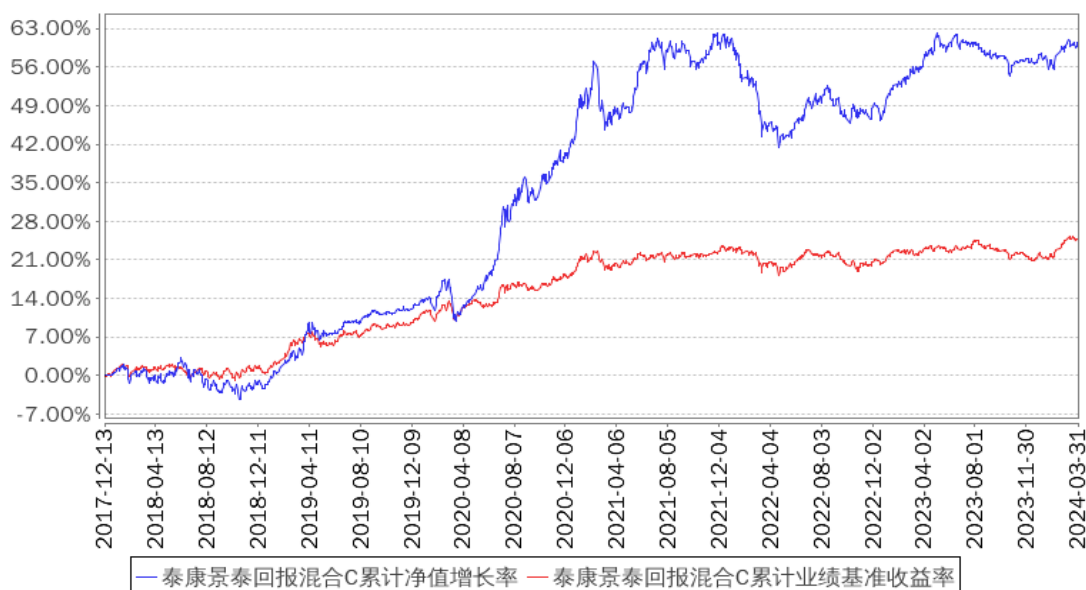
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.39% | 0.30% | 2.16% | 0.20% | -0.77% | 0.10% |
| 过去六个月 | 1.56% | 0.26% | 1.78% | 0.18% | -0.22% | 0.08% |
| 过去一年 | 2.11% | 0.27% | 1.75% | 0.18% | 0.36% | 0.09% |
| 过去三年 | 8.80% | 0.40% | 4.15% | 0.21% | 4.65% | 0.19% |
| 过去五年 | 50.94% | 0.46% | 16.77% | 0.23% | 34.17% | 0.23% |
| 自基金合同 生效起至今 | 60.43% | 0.46% | 24.85% | 0.24% | 35.58% | 0.22% |

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

泰康景泰回报混合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



泰康景泰回报混合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 2017 年 12 月 13 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 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

| | | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | |
|-----|---------|-----------------|------|------|--|
| 黄钟 | 本基金基金经理 | 2020 年 1 月 6 日 | - | 13 年 | 黄钟于 2013 年 7 月加入泰康资产，担任信用评估研究员，2016 年 10 月加入泰康公募，现任泰康基金固定收益基金经理。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析师。2019 年 9 月 23 日至 2023 年 6 月 9 日担任泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 1 月 6 日至今担任泰康景泰回报混合型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 17 日至今担任泰康安泽中短债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 14 日至今担任泰康鼎泰一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 6 月 9 日至今担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2023 年 12 月 7 日至今担任泰康悦享 30 天持有期债券型证券投资基金基金经理。2023 年 12 月 26 日至今担任泰康中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。 |
| 宋仁杰 | 本基金基金经理 | 2020 年 1 月 10 日 | - | 12 年 | 宋仁杰于 2018 年 3 月加入泰康公募，现任泰康基金股票基金经理。曾任华商基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理，深圳东方君正资产管理有限公司基金经理等职务。2019 年 9 月 16 日至今担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 1 月 10 日至今担任泰康景泰回报混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 30 日至今担任泰康品质生活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，一季度体现了经济转型的特征。传统部门的代表如地产继续处于调整周期，基建则延续了宏观增速尚可但微观化债承压的特征。但出口部门受益于外需总体景气度较好，制造业 PMI 在 3 月份也回到 50 上方。消费则呈现出春节期间偏强、春节过后一般的特征，持续性有待观察。

债券市场方面，收益率震荡下行，超长端债券表现亮眼。一季度债券供给偏少、而配置盘的刚性配置需求陆续释放，叠加交易盘脉冲式买入，导致总体上供需关系较为有利。此外，一季度传统周期部门的基本面偏弱，融资需求一般，也为利率的震荡下行提供了土壤。资金利率总体围绕政策利率波动，资金的波动性下降也形成利好。

固收投资策略上，信用债方面，在严格防范信用风险的前提下，密切跟踪中微观行业和个体的变化，获取票息价值和资本利得，在利率债方面，根据资金、估值、供需、宏观经济积极调整久期水平，获取波段收益。根据转债估值和股票市场行情判断，参与转债的波段操作，积极获取个券收益，为组合贡献收益。

权益市场表现来看，一季度由于市场预期和流动性等因素，A 股出现比较大的波动，上证指数上涨 2.23%；各行业分化较大，银行、石油石化、煤炭等行业涨幅居前，医药、计算机、电子等行业跌幅居前。

本基金未来将立足高质量发展的新常态，寻找真正具有长期竞争力，能受益于中国经济高质量增长和行业发展趋势的优质公司。一季度本基金维持较为稳定的持仓结构，仍然重点在高股息、消费、医药、出口、有色等方向或行业进行了配置。我们将继续坚持以获取稳健的相对收益为目标，行业相对均衡，个股适度集中，继续看好具有垄断地位，现金流好，分红率较高的优质

企业。

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 1.6288 元,本报告期基金 A 份额净值增长率为 1.47%;截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.6043 元,本报告期基金 C 份额净值增长率为 1.39%;同期业绩比较基准增长率为 2.16%。

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 | 351,625,027.28 | 22.11 |
| | 其中:股票 | 351,625,027.28 | 22.11 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,181,769,698.97 | 74.32 |
| | 其中:债券 | 1,181,769,698.97 | 74.32 |
| | 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 | 55,423,495.97 | 3.49 |
| 8 | 其他资产 | 1,372,075.88 | 0.09 |
| 9 | 合计 | 1,590,190,298.10 | 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

| 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 | 7,386,000.00 | 0.63 |
| B | 采矿业 | 36,305,500.00 | 3.08 |
| C | 制造业 | 161,186,351.42 | 13.66 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | | - |
| E | 建筑业 | | - |
| F | 批发和零售业 | | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 101,432,065.45 | 8.60 |
| H | 住宿和餐饮业 | | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 31,652,760.82 | 2.68 |
| J | 金融业 | | - |
| K | 房地产业 | | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,097.60 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 23,748.61 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 5,605,503.38 | 0.48 |
| 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 | 8,030,000.00 | 0.68 |
| S | 综合 | | - |
| | 合计 | 351,625,027.28 | 29.80 |

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

| 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 | 601006 | 大秦铁路 | 9,700,000 | 71,392,000.00 | 6.05 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 20,000 | 34,058,000.00 | 2.89 |
| 3 | 600941 | 中国移动 | 280,000 | 29,612,800.00 | 2.51 |
| 4 | 002223 | 鱼跃医疗 | 640,000 | 21,952,000.00 | 1.86 |
| 5 | 601000 | 唐山港 | 4,390,100 | 17,955,509.00 | 1.52 |
| 6 | 600988 | 赤峰黄金 | 900,000 | 14,715,000.00 | 1.25 |
| 7 | 002557 | 洽洽食品 | 350,000 | 12,817,000.00 | 1.09 |
| 8 | 600582 | 天地科技 | 1,800,000 | 12,672,000.00 | 1.07 |
| 9 | 000975 | 银泰黄金 | 650,000 | 11,758,500.00 | 1.00 |
| 10 | 603129 | 春风动力 | 95,000 | 11,390,500.00 | 0.97 |

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 | 96,178,755.85 | 8.15 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|--------|
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 357,719,976.45 | 30.32 |
| | 其中：政策性金融债 | 205,777,063.94 | 17.44 |
| 4 | 企业债券 | 13,459,896.55 | 1.14 |
| 5 | 企业短期融资券 | 342,731,896.09 | 29.05 |
| 6 | 中期票据 | 340,161,271.82 | 28.83 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 31,517,902.21 | 2.67 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,181,769,698.97 | 100.16 |

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 | 2128042 | 21 兴业银行二级 02 | 500,000 | 52,001,404.37 | 4.41 |
| 2 | 240004 | 24 附息国债 04 | 490,000 | 49,358,884.62 | 4.18 |
| 3 | 230203 | 23 国开 03 | 480,000 | 49,115,606.56 | 4.16 |
| 4 | 019678 | 22 国债 13 | 460,000 | 46,819,871.23 | 3.97 |
| 5 | 190205 | 19 国开 05 | 420,000 | 44,502,649.18 | 3.77 |

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

无。

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

兴业银行股份有限公司因衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格等行为在本报告编制前一年内受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的责令改正和公开处罚。

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 139,563.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | 912,820.29 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 319,692.53 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,372,075.88 |

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 | 127045 | 牧原转债 | 883,024.61 | 0.07 |
| 2 | 123200 | 海泰转债 | 667,372.36 | 0.06 |
| 3 | 113648 | 巨星转债 | 610,126.52 | 0.05 |
| 4 | 113534 | 鼎胜转债 | 595,727.12 | 0.05 |
| 5 | 123162 | 东杰转债 | 501,420.55 | 0.04 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 6 | 123215 | 铭利转债 | 491,607.67 | 0.04 |
| 7 | 128042 | 凯中转债 | 478,926.49 | 0.04 |
| 8 | 113677 | 华懋转债 | 466,203.77 | 0.04 |
| 9 | 113524 | 奇精转债 | 464,462.04 | 0.04 |
| 10 | 123107 | 温氏转债 | 442,969.61 | 0.04 |
| 11 | 113618 | 美诺转债 | 436,774.18 | 0.04 |
| 12 | 113651 | 松霖转债 | 415,508.60 | 0.04 |
| 13 | 111007 | 永和转债 | 413,968.25 | 0.04 |
| 14 | 113662 | 豪能转债 | 409,378.85 | 0.03 |
| 15 | 123071 | 天能转债 | 405,452.72 | 0.03 |
| 16 | 113545 | 金能转债 | 404,473.81 | 0.03 |
| 17 | 123196 | 正元转 02 | 403,361.91 | 0.03 |
| 18 | 113643 | 风语转债 | 397,227.40 | 0.03 |
| 19 | 111004 | 明新转债 | 393,427.16 | 0.03 |
| 20 | 128074 | 游族转债 | 389,570.79 | 0.03 |
| 21 | 123161 | 强联转债 | 386,995.97 | 0.03 |
| 22 | 123138 | 丝路转债 | 373,844.51 | 0.03 |
| 23 | 123182 | 广联转债 | 370,169.01 | 0.03 |
| 24 | 113628 | 晨丰转债 | 369,099.73 | 0.03 |
| 25 | 118015 | 芯海转债 | 351,696.54 | 0.03 |
| 26 | 118034 | 晶能转债 | 350,905.98 | 0.03 |
| 27 | 118042 | 奥维转债 | 350,571.21 | 0.03 |
| 28 | 118035 | 国力转债 | 347,852.72 | 0.03 |
| 29 | 110062 | 烽火转债 | 347,399.88 | 0.03 |
| 30 | 123176 | 精测转 2 | 347,298.38 | 0.03 |
| 31 | 123089 | 九洲转 2 | 346,518.95 | 0.03 |
| 32 | 123109 | 昌红转债 | 344,675.60 | 0.03 |
| 33 | 128118 | 瀛通转债 | 344,290.74 | 0.03 |
| 34 | 113661 | 福 22 转债 | 344,284.22 | 0.03 |
| 35 | 110055 | 伊力转债 | 344,075.07 | 0.03 |
| 36 | 127052 | 西子转债 | 343,671.97 | 0.03 |
| 37 | 123210 | 信服转债 | 343,211.64 | 0.03 |
| 38 | 128083 | 新北转债 | 342,994.80 | 0.03 |
| 39 | 127040 | 国泰转债 | 341,719.68 | 0.03 |
| 40 | 123059 | 银信转债 | 340,786.94 | 0.03 |
| 41 | 127055 | 精装转债 | 339,616.84 | 0.03 |
| 42 | 123170 | 南电转债 | 339,165.76 | 0.03 |
| 43 | 113061 | 拓普转债 | 337,474.17 | 0.03 |
| 44 | 118039 | 煜邦转债 | 336,942.78 | 0.03 |
| 45 | 127074 | 麦米转 2 | 336,417.27 | 0.03 |
| 46 | 111010 | 立昂转债 | 336,266.38 | 0.03 |
| 47 | 113673 | 岱美转债 | 335,012.53 | 0.03 |

| | | | | |
|----|--------|----------|------------|------|
| 48 | 127026 | 超声转债 | 334,149.47 | 0.03 |
| 49 | 113647 | 禾丰转债 | 333,117.68 | 0.03 |
| 50 | 113621 | 彤程转债 | 332,210.17 | 0.03 |
| 51 | 110090 | 爱迪转债 | 331,970.17 | 0.03 |
| 52 | 118033 | 华特转债 | 331,102.97 | 0.03 |
| 53 | 128095 | 恩捷转债 | 330,675.28 | 0.03 |
| 54 | 110085 | 通 22 转债 | 330,655.47 | 0.03 |
| 55 | 118003 | 华兴转债 | 330,426.07 | 0.03 |
| 56 | 123190 | 道氏转 02 | 330,421.19 | 0.03 |
| 57 | 113602 | 景 20 转债 | 330,339.40 | 0.03 |
| 58 | 118011 | 银微转债 | 329,849.90 | 0.03 |
| 59 | 113593 | 沪工转债 | 329,194.40 | 0.03 |
| 60 | 118043 | 福立转债 | 327,762.61 | 0.03 |
| 61 | 113675 | 新 23 转债 | 326,565.04 | 0.03 |
| 62 | 118027 | 宏图转债 | 325,784.12 | 0.03 |
| 63 | 123128 | 首华转债 | 325,610.58 | 0.03 |
| 64 | 118026 | 利元转债 | 325,581.94 | 0.03 |
| 65 | 123063 | 大禹转债 | 325,551.05 | 0.03 |
| 66 | 113045 | 环旭转债 | 321,077.35 | 0.03 |
| 67 | 118013 | 道通转债 | 319,327.81 | 0.03 |
| 68 | 123048 | 应急转债 | 318,346.17 | 0.03 |
| 69 | 127070 | 大中转债 | 314,144.52 | 0.03 |
| 70 | 127086 | 恒邦转债 | 296,913.36 | 0.03 |
| 71 | 113055 | 成银转债 | 296,617.98 | 0.03 |
| 72 | 123076 | 强力转债 | 284,229.79 | 0.02 |
| 73 | 111000 | 起帆转债 | 283,979.12 | 0.02 |
| 74 | 127079 | 华亚转债 | 281,638.08 | 0.02 |
| 75 | 110081 | 闻泰转债 | 277,103.39 | 0.02 |
| 76 | 123124 | 晶瑞转 2 | 276,807.34 | 0.02 |
| 77 | 132026 | G 三峡 EB2 | 262,246.65 | 0.02 |
| 78 | 123174 | 精锻转债 | 261,919.98 | 0.02 |
| 79 | 123078 | 飞凯转债 | 246,298.49 | 0.02 |
| 80 | 113024 | 核建转债 | 204,298.15 | 0.02 |
| 81 | 123143 | 胜蓝转债 | 182,334.57 | 0.02 |
| 82 | 111008 | 沿浦转债 | 173,890.02 | 0.01 |
| 83 | 127032 | 苏行转债 | 159,192.66 | 0.01 |
| 84 | 123131 | 奥飞转债 | 158,123.52 | 0.01 |
| 85 | 113050 | 南银转债 | 154,992.31 | 0.01 |
| 86 | 113021 | 中信转债 | 145,486.50 | 0.01 |
| 87 | 123054 | 思特转债 | 139,972.33 | 0.01 |
| 88 | 113066 | 平煤转债 | 109,557.06 | 0.01 |
| 89 | 118021 | 新致转债 | 3,585.91 | 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 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 泰康景泰回报混合 A | 泰康景泰回报混合 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 770,883,048.49 | 54,037,260.42 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,799,964.57 | 9,762,450.32 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 105,870,700.22 | 5,316,912.11 |
| 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 | 666,812,312.84 | 58,482,798.63 |

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

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。

7.2 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。

§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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|------|------------|----------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 20240101 - 20240331 | 300,635,488.19 | 0.00 | 0.00 | 300,635,488.19 | 41.45 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

当本基金出现单一持有人持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。

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景泰回报混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康景泰回报混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康景泰回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康景泰回报混合型证券投资基金托管协议》。
- (五) 《泰康景泰回报混合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（《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 4 月 19 日