泰康资产管理有限责任公司

泰康沪港深精选灵活配置混合型
证券投资基金更新招募说明书摘要
（2018 年第 1 次更新）

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

重要提示

本基金募集申请已于 2016 年 4 月 1 日获中国证监会证监许可『2016』661 号文准予募集注册，基金合同于 2016 年 6 月 6 日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读基金合同和本招募说明书等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行负担。投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，基金投资对象与投资策略引致的特有风险，等等。

本基金可投资中小企业私募债券，该券种具有较高的流动性风险和信用风险。中小企业私募债的信用风险是指中小企业私募债券发行人可能由于规模小、经营历史短、业绩不稳定、内部治理规范性不够、信息透明度低等因素导致其不能履行还本付息的责任而使预期收益与实际收益发生偏离的可能性，从而使基金投资收益下降。基金可通过多样化投资来分散这种非系统风险，但不能完全规避。流动性风险是指中小企业私募债券由于其转让方式及其投资持有人数的限制，存在变现困难或无法在适当或期望时变现引起损失的可能性。

本基金可投资国债期货，国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收

益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

基金名称仅表明基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金初始面值 1.00 元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金投资人欲来了解本基金详情，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书已经本基金托管人招商银行股份有限公司复核，所载内容截止日为 2017 年 12 月 5 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日。财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：泰康资产管理有限责任公司

成立日期：2006 年 2 月 21 日

住所：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室

办公地址：北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层

批准设立机关及批准设立文号：中国保监会保监发改[2006]69 号

基金管理资格批准机关及批准文号：中国证监会证监许可[2015]218 号

法定代表人：段国圣

组织形式：有限责任公司（国内合资）

注册资本：10 亿元人民币

联系电话：010-57691999

联系人：何纬

股权结构：泰康保险集团股份有限公司占公司注册资本的 99.41%；中诚信托有限责任公司占公司注册资本的 0.59%。

（二）基金管理人主要人员情况

1、董事会成员

陈东升先生：董事长、董事会提名薪酬委员会委员，经济学博士，现任泰康保险集团股份有限公司董事长兼首席执行官，泰康人寿保险有限责任公司董事长，中国精算师协会会长，亚布力中国企业家论坛理事长，楚商联合会会长，是中国嘉德国际拍卖有限公司和泰康人寿保险股份有限公司的创始人。陈东升先生曾任对外贸易合作部国际贸易研究所助理研究员，国务院发展研究中心《管理世界》杂志社常务副总编，开创了中国 500 强企业评比的先河，被《财富》（中文版）评选为“2004 年度中国商人”。

任道德先生：副董事长，统计学学士，现任泰康保险集团股份有限公司董事、弘泰恒业投资有限责任公司董事长。任道德先生曾任职于中国人民银行和交通银行，曾任泰康人寿保险股份有限公司执行副总裁兼首席财务官、执行副总裁兼首席投资官，中国人保资产管理公司总裁等职务。

陶修明先生：独立董事、董事会提名薪酬委员会主席，法学博士，现任北京市君泽君律师事务所律师，创始合伙人暨管委会主任，兼任中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员（兼专家咨询委员会委员），北京仲裁委员会仲裁员，ICC 仲裁委员会委员（兼金融工作小组委员）及国际商会（中国）委员会委员，上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁员，香港国际仲裁中心仲裁员，台湾中华仲裁协会仲裁员，海峡两岸仲裁中心仲裁员，吉隆坡国际仲裁中心仲裁员以及广州、重庆、珠

海等地仲裁机构仲裁员，中国银行间市场交易商协会下属金融衍生品专业委员会委员、认证专家委员会委员和法律专业委员会委员，中国银行业协会法律专家成员，中国保险资产管理业协会专家委员会委员，全国律师协会金融证券委员会委员。陶修明先生曾任职于中国法律咨询中心暨天平律师事务所、中国社会科学院法学研究所。

徐华先生：独立董事、董事会审计与风险管理委员会主席，会计学硕士，具有中国注册会计师、高级会计师资格，现任致同会计师事务所（特殊普通合伙）主任会计师、首席合伙人，致同国际治理委员会、战略委员会成员。兼任国开证券有限责任公司独立董事、中原农业保险股份有限公司独立董事、财政部会计信息化委员会委员、中国注册会计师协会信息化委员会委员、北京国际税收研究会副会长等职务。徐华先生曾任北京注册会计师协会常务副秘书长、北京市财政局处长、财政部会计准则委员会咨询专家委员会委员、中国证券业协会第二届财务会计委员会委员等职务。

宋敏先生：独立董事，经济学博士，现任香港大学经济与工商管理学院教授，中国金融研究中心创始主任。宋敏先生曾兼任上交所及深交所博士后导师，香港政府中央政策组(CPU)顾问，香港政府金融人力资源发展委员会成员，深圳前海试验区咨询委员，中国投资公司(CIC)咨询顾问，国家开发银行国开智库专家委员，国际金融论坛学术执行委员等职务。

刘经纶先生：董事、董事会审计与风险管理委员会委员，经济学博士，现任泰康保险集团股份有限公司总裁兼首席运营官、泰康人寿保险有限责任公司监事会主席、泰康在线财产保险股份有限公司董事长。刘经纶先生曾任中国人民保险公司江西分公司人身险处处长，中国平安保险公司总公司人身险总经理助理，中国平安保险公司北京分公司总经理，泰康人寿保险股份有限公司常务副总裁、总裁兼首席运营官等职务。

周国端先生：董事、董事会审计与风险管理委员会委员，保险及财务博士，现任泰康保险集团股份有限公司执行副总裁兼首席财务官，泰康人寿保险有限责任公司董事。周国端先生曾任职于旅行家集团、摩根斯坦利公司，曾任国立台湾大学财务金融所教授，瑞士信贷金融集团台湾咨询顾问，苏黎世金融集团大中华区寿险首席顾问，台湾财团法人保险犯罪防治中心董事长，台湾财团法人保险事

业发展中心董事长，台湾宏泰人寿保险股份有限公司董事长兼 CEO，泰康人寿保险股份有限公司独立董事、执行副总裁兼首席财务官（财务负责人）等职务。

段国圣先生：董事，理学硕士、工学博士、经济学博士后、数学副教授、应用经济学研究员（教授）。现任泰康保险集团股份有限公司执行副总裁兼首席投资官、泰康人寿保险有限责任公司董事、泰康资产管理有限责任公司首席执行官，兼任中国保险资产管理业协会会长、清华大学五道口金融学院金融硕士研究生指导教师；曾任中保投资有限责任公司董事长，中国保险业偿付能力监管标准委员会第一届、第二届委员。段国圣先生带领泰康资产在寿险资金、养老金、投连产品、项目投资等资产管理业务方面业绩斐然，至今已积累了 20 多年的保险资金投资管理经验。2016 年 7 月，荣获“资产管理 2016 年度领军人物卓越奖”、“资产管理 2016 年度领军人物杰出贡献奖”，获评 2015 中国保险年度人物。

苗力女士：董事、董事会提名薪酬委员会委员，工商管理硕士，现任泰康保险集团股份有限公司副总裁兼首席人力资源官。苗力女士曾任郑州大学讲师，交通银行郑州分行支行行长，太平洋保险公司郑州分公司常务副总经理、总公司办公室副主任，泰康人寿保险股份有限公司办公室主任、人力资源部总经理、银保部总经理、北京分公司总经理、CEO 办公室主任兼办公室主任，泰康养老保险股份有限公司副总经理、总经理等职务。

2、监事会成员

李华安先生：监事会主席，工商管理硕士，现任泰康人寿保险有限责任公司合规负责人。李华安先生曾任湖北省武汉市东西湖区财政局党组成员、办公室主任、监察科科长，泰康人寿保险股份有限公司湖北分公司副总经理、云南分公司副总经理、广西分公司总经理、稽核监察部总经理，泰康保险集团股份有限公司稽核中心总经理等职务。

朱延明先生：监事，财务金融硕士，美国注册金融分析师，现任泰康保险集团股份有限公司风险管理部总经理。朱延明先生曾任台湾保险事业发展中心董事长办公室主任，台湾宏泰人寿股份有限公司财务企划处、资本风险管理处协理，泰康人寿保险股份有限公司财务精算企划部数据管理处处经理、风险管理部副总经理等职务。

任建畅先生：职工代表监事，国际金融硕士，现任泰康资产管理有限责任公

司金融工程部负责人。任建畅先生曾任国家计委财政金融司主任科员，中国投资咨询公司投资顾问部助理总经理，麦肯锡中国公司北京办公室高级研究专员，泰康人寿保险股份有限公司资产管理部总经理等职务。

霍焱先生：职工代表监事，工商管理硕士，现任泰康资产管理有限责任公司投后管理部负责人。霍焱先生曾任广东北电通信设备有限公司财务经理，摩托罗拉中国有限公司财务经理，工银瑞信基金管理有限公司财务总监，泰康资产管理有限责任公司财务部总经理、财务负责人等职务。

3、总经理及其他高级管理人员

段国圣先生，首席执行官（总经理），简历同上。

金志刚先生，泰康资产管理有限责任公司副总经理，公募事业部负责人，统计学硕士，现任泰康资产管理有限责任公司公募事业部负责人。金志刚先生曾任中国航天工业总公司 CAD/CAM 软件开发与培训中心应用软件工程师，泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心研究员，泰康资产管理有限责任公司固定收益投资部助理总经理兼高级研究员、副总经理、总经理、固定收益投资总监等职务。

周峰女士，公募合规负责人，国际法学硕士，现任泰康资产管理有限责任公司合规法律部负责人。周峰女士曾任国家环境保护总局中日中心英语翻译，怡文律师事务所非诉业务组律师，德恒律师事务所金融证券部主办律师，中国国际金融有限公司资产管理部风控组负责人、法律事务部律师等职务。

4、本基金基金经理

刘伟先生，概率论与数理统计硕士。2011 年 6 月加入泰康资产，历任风险控制部风险管理研究员、高级经理，公募事业部投资部金融工程研究员、基金经理助理。现任公募事业部投资部量化投资总监。2017 年 5 月 4 日至今任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 29 日至今担任泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金经理。曾任中国人民健康保险公司产品开发部/精算部精算岗。

黄成扬先生，金融学硕士。2017 年 7 月加入泰康资产，现任泰康资产管理有限责任公司公募事业部投资部股票投资总监。2017 年 11 月 21 日至今担任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。曾任金捷基金研究部研究员、恒星资产研究部研究员、

长盛基金国际业务部高级研究员、专户投资经理、基金经理等职务。

5、投资决策委员会成员名单

金志刚先生，公募投资决策委员会主席，简历同上。

桂跃强先生，公募投资决策委员会成员，财政金融学硕士。2015 年 8 月加入泰康资产，现任泰康资产管理有限责任公司公募事业部股票投资董事总经理、公募事业部权益投资负责人，2015 年 12 月 8 日至今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 6 月 8 日至今担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月 28 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，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 6 月 20 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。曾任新华基金管理有限公司基金管理部副总监、基金经理。

蒋利娟女士，公募投资决策委员会成员，国民经济学硕士。2008 年加入泰康资产，历任集中交易室交易员，固定收益部固定收益投资高级经理、总监。现任公募事业部固定收益投资执行总监。2015 年 6 月 19 日至今担任泰康薪意保货币市场基金基金经理，2015 年 9 月 23 日至今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-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，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 日至今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 日至今担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。

庞水珍女士，公募投资决策委员会成员，技术经济及管理硕士。2014 年 7 月加入泰康资产，现任公募事业部集中交易室固定收益交易总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987 年 4 月 8 日

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

注册资本：252.20 亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2017 年 9 月 30 日，本集团总资产 61,692.39 亿元人民币，高级法下资本充足率 15.01%，权重法下资本充足率 12.26%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室 5 个职能处室，现有员工 76 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为

托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”；2017 年 6 月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”，进一步扩大我行托管业务在国际资管和托管业界的影响力。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执

行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991 年至 1995 年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995 年 6 月至 2001 年 10 月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001 年 10 月至 2006 年 3 月，历任北京分行行长助理、副行长；2006 年 3 月至 2008 年 6 月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008 年 6 月至 2012 年 6 月，任北京分行行长、党委书记；2012 年 6 月至 2013 年 11 月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013 年 11 月至 2014 年 12 月，任招商银行总行行长助理；2015 年 1 月起担任本行副行长；2016 年 11 月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002 年 9 月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2017年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管316只开放式基金。

三、相关服务机构

（一）基金销售机构

（1）直销中心柜台

名称：泰康资产管理有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室

办公地址：北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层法定代表人：段国圣

全国统一客户服务电话：4001895522

传真：010-57697399

联系人：曲晨

电话：010-57697547

网站：www.tkfunds.com.cn

（2）投资者亦可通过基金管理人直销电子交易系统（包括网上交易系统、电话交易系统、泰康保手机客户端、“泰康资产微基金”微信公众号以及基金管理人另行公告的其他电子交易系统等）办理本基金的开户及认购等业务。

网上交易请登录：https://trade.tkfunds.com.cn/

电话交易请拨打：4001895522

APP：泰康保手机客户端

微信公众号：泰康资产微基金

2、其他销售机构

（1） 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

联系人：洪渊

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（2） 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

联系人：李卓凡

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（3） 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：赵姝

客服电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

（4） 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：王志刚

客服电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

（5） 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：姚磊

客服电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

（6） 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3 号楼 C 座 7 楼

法定代表人：其实

联系人：黄妮娟

客服电话：400-1818188

网址：www.1234567.com.cn

（7） 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903～906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

（8） 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：吴强

客服电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

（9） 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 层

法定代表人：汪静波

联系人：张裕

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

（10） 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18F

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

客服电话：400-920-0022

网址：www.hexun.com

（11） 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室

法定代表人：胡伟

联系人：牛亚楠

客服电话：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com

（12） 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（13） 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：孟召社

客服电话：400-928-2266

网址：www.dtfunds.com

（14） 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：刘潇

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

（15） 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

客服电话：400-166-1188

网址：http://8.jrj.com.cn/

（16） 中经北证（北京）资产管理有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

法定代表人：徐福星

联系人：李美

客服电话：400-600-0030

网址：www.bzfunds.com

（17） 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：李晓明

客服电话：4006-433-389

网址：www.vstonewealth.com

（18） 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

客服电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

（19） 乾道金融信息服务（北京）有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 1302

法定代表人：王兴吉

联系人：刘晓婧

客服电话：4000-888-080

网址：www.qiandaojr.com

（20） 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

客服电话：4006-411-999

网址：www.haojiyoujijin.com

（21） 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人：赖任军

联系人：张烨

客服电话：400-9500-888

网址：www.jfz.com

（22） 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（23） 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21&28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：李日欣

客服电话：400-818-8866

网址：www.shengshiview.com

（24） 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

（25） 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：虞鲜鲜

客服电话：400-921-7755

网址：www.leadfund.com.cn

（26） 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部 A 座 15 层

法定代表人：陈超

联系人：万容

客服电话个人业务：95118；企业业务：400-088-8816

网址：http://fund.jd.com

（27） 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号北美广场 A 座 1002 室

法定代表人：王翔

联系人：潘美玲

客服电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn"

（28） 济安财富（北京）资本管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

客服电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

（29） 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

客服电话：021-52822063

网址：www.66zichan.com

（30） 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼

法定代表人：马刚

联系人：杨徐霆

客服电话：400-66-95156

网址：www.tonghuafund.com

（31） 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

客服热线：4006-788-887

交易网站：www.zlfund.cn

门户网站：www.jjmmw.com

（32） 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

（33） 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

法定代表人：陈柏青

联系人：傅强

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

（34） 北京格上富信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

联系人：张林

客户电话：400-066-8586

网址：www.igesafe.com

（35） 东海期货有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

联系人：李天雨

客服电话：95531、400-8888588

网址： www.qh168.com.cn

（36） 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：邓颜

客服电话：95551 或 4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

（37） 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编:200031）

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

（38） 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

法定代表人：李季

联系人：王叔胤

客服电话：4008000562

网址：www.hysec.com

（39） 上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：郭林

联系人：陈媛

客服电话：400-820-5999

网址：www.shhxzq.com

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金基金合同等的规定，选择其他符合要求的销售机构销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）登记机构

名称：泰康资产管理有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室

办公地址：北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层

法定代表人：段国圣

全国统一客户服务电话：4001895522

传真：010-56814888

联系人：陈进

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：安冬、陆奇

联系人：陆奇

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：朱宇、李姗

联系电话：010-65337327

传真：010-65338800

联系人：李姗

四、基金的名称

泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金、契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金主要投资于中国大陆 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，精选沪港深股票市场中的优质公司股票，力争获取超越业绩比较基准的最大化投资收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公开发行公司债券、非公开发行公司债券、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购等)、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款、同业存单和其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货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(但须符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通投资标的股票的

比例占基金资产的0-95%);基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定，不须召开份额持有人大会。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

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，力争利用主动式组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

1、大类资产配置策略

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析方法进行股票资产与债券资产配置。分析因素包括宏观经济运行状况、宏观经济政策、证券市场资金供求及流动性状况、股票市场与债券市场及其它替代资产市场的相对投资价值、市场交易与投资者情绪及行为等，同时考虑各类资产的风险水平，在股票与债券等资产类别之间进行动态资产配置。本基金将根据 A 股、H 股溢价率的变化，并综合考虑市场投资者结构、流动性和成长空间等因素，适当调整 A 股与港股的配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。

2、股票市场投资策略

本基金在股票在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，对股票进行系统化、程序化筛选、排序，在

一级、二级市场全面遴选优质估值水平相对合理的国内 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进行重点投资。

（1）增长因素

首先，本基金将综合考虑宏观经济、产业政策、市场因素，并参考国家统计局的“中国行业企业景气指数”，对各行业的景气状况进行比较分析。评估产业链对各细分子行业财富效应和替代效应的影响，重点选择处于行业成长期和成熟期的细分子行业。

其次，主要考虑上市公司盈利的历史及将来预期的增长率。 此因素不仅含有公司的历史盈利增长能力，也包含了市场预期的将来盈利增长能力。 此盈利因素组的因子有销售收入、净利润及现金流增长率等。

（2）估值水平

本基金根据一系列历史和预期的财务指标，结合定性方法，分析公司盈利稳固性，判断相对投资价值。主要指标包括：EV/EBITDA、EV/Sales、P/E、P/B、P/RNAV、股息率等，在全市场范围内选择增长与估值性价比最好的公司。

（3）盈利能力

盈利能力是反映公司经营管理及盈利方面的能力，此因素是对估值因素的重要补充，因为市场通常会对盈利能力强弱不同的公司给予不同的估值，在盈利能力因素组中的因子有净资产回报率（ROE），资本投资回报率（ROIC）等因素。

（4）财务风险

财务风险因素是反映公司为维持正常运行或某些盈利目标所采用的融资规模，此因素也是对估值因素的重要补充。同样地，市场通常会对负债率不同的公司给予不同的估值。考虑此因素可以在市场极端的情况下，寻找安全边际，有效地避免高风险投资，此因素组中的因子有净资产负债率（Dt/Eq），总资产负债率（Dt/A）等因素。

3、港股通标的股票投资策略

本基金将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。

本基金重点投资于基本面良好、相对 A 股市场估值合理，具备优质成长性及注重现金分红的股票进行长期投资。本基金另外会重点关注（1）在香港市场

上市、具有行业代表性的优质中资公司，如国内互联网及软件企业、新能源及光伏、国内部分消费行业领导品牌等上市公司；（2）A 股市场稀缺的香港本地和外资公司，如博彩公司、香港本土成长消费明星公司、综合性的地产公司、交易所等上市公司。

本基金所投资香港市场股票标的除适用上述个股投资策略外，本基金投资香港市场股票标的还需关注：

（1）香港股票市场制度与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面；

（2）港股通每日额度应用情况；

（3）人民币与港币间的汇兑比率变化。

4、债券市场投资策略

本基金在分析各类债券资产的信用风险、流动性风险及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力的基础上，通过比较或合理预期各类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整优先配置的资产类别和配置比例。

（1）利率品种投资策略

本基金在对国内外宏观经济形势研究基础上，对利率期限结构和债券市场变化趋势进行深入分析和预测，确定并动态调整利率品种的期限配置策略。

（2）信用品种投资策略

根据国民经济运行周期阶段，分析债券发行人所处行业发展前景，发行人业务发展状况，企业市场地位，财务状况，管理水平，债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定债券的信用风险利差与投资价值。

对于证券公司短期公司债券，本基金对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，综合考虑和分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、债券收益率等要素，确定投资决策。本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，并适当控制债券投资组合整体的久期，防范流动性风险。

（3）可转换债券投资

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点，是本基金的重要投资对象之一。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，以合理价格买入并持有。

（4）资产支持证券投资策略

本基金将投资包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券。本基金通过考量宏观经济走势、支持资产所在行业景气情况、资产池结构、提前偿还率、违约率、市场利率等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

（5）中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

（6）流动性管理策略

本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、正回购、持有高流动性资产、银行定期存款提前支取、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性，以满足日常的基金资产变现需求。

5、其他金融工具的投资策略

（1）股指期货投资策略

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

（2）国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人通过构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、隐含波动率水平、套期保值的稳定性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

（3）权证投资策略

本基金还将在法规允许的范围内，基于谨慎原则利用权证以及其它金融工具进行套利交易或风险管理，为基金收益提供增加价值。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。

如法律法规或监管机构以后允许本类基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对提高组合整体收益为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下，通过对标的品种的研究，谨慎投资。

九、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率*40%+恒生指数收益率*40%+中债新综合财富（总值）指数收益率*20%。

业绩比较基准选择理由：

沪深 300 指数是由中证指数公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量 A 股投资部分的绩效。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。

中债新综合财富（总值）指数由中央国债登记结算公司编制，隶属于中债总指数族分类，该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的

所有公开发行的可流通债券，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，涵盖上市地点包括银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、柜台。中债新综合财富（总值）指数的一个重要特点在于，在计算过程中包含了利息再投资的因素，因此理论收益率较其他债券指数更高，对投资的要求也更高。

鉴于上述指数的权威性、代表性，以及本基金的投资目标和投资范围，设定本基金的基准为沪深 300 指数收益率*40%+恒生指数收益率*40%+中债新综合财富（总值）指数收益率*20%，选用该业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，与基金托管人协商一致并按监管部门要求履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金为跨境证券投资的基金，主要投资于中国大陆 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场。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。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

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。

本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 2017 年 12 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。

本投资组合报告所载数据截止 2017 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	1,030,696,299.56	83.80
	其中：股票	1,030,696,299.56	83.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	187,788,927.20	15.27
	其中：债券	187,788,927.20	15.27
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	1.92	0.00
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	3,473,614.90	0.28
8	其他资产	7,968,154.77	0.65
9	合计	1,229,926,998.35	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 952,227,979.99 元，占期末资产净值比例为 78.00%。

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	39,793.60	0.00
C	制造业	406,961.23	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	33,337.23	0.00
F	批发和零售业	26,380.90	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	77,582,028.51	6.36
K	房地产业	110,929.00	0.01
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.01
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	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	31,224.45	0.00
S	综合	-	-
	合计	78,468,319.57	6.43

(2)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	18,601,671.45	1.52
B 消费者非必需品	70,509,570.50	5.78
C 消费者常用品	29,367,177.32	2.41
D 能源	77,005,260.29	6.31
E 金融	302,752,060.78	24.80
F 医疗保健	25,784,421.71	2.11
G 工业	70,758,086.98	5.80
H 信息技术	161,302,223.12	13.21
I 电信服务	89,729,064.73	7.35
J 公用事业	38,510,773.88	3.15
K 房地产	67,907,669.23	5.56
合计	952,227,979.99	78.00

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

3.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	00700	腾讯控股	419,132	119,729,247.12	9.81
2	00939	建设银行	9,284,000	51,154,840.00	4.19
2	601939	建设银行	3,959,059	27,594,641.23	2.26
3	00941	中国移动	1,045,000	70,276,250.00	5.76
4	01398	工商银行	5,677,245	27,988,817.85	2.29
4	601398	工商银行	3,129,870	18,779,220.00	1.54
5	02318	中国平安	560,500	28,551,870.00	2.34
5	601318	中国平安	260,200	14,092,432.00	1.15
6	03988	中国银行	5,474,475	17,901,533.25	1.47
6	601988	中国银行	2,864,669	11,802,436.28	0.97
7	02628	中国人寿	1,319,448	26,059,098.00	2.13
8	00005	汇丰控股	399,200	25,963,968.00	2.13
9	00883	中国海洋石油	2,691,000	23,034,960.00	1.89
10	00386	中国石油化工	4,266,000	21,202,020.00	1.74

		股份			

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。

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	9,981,000.00	0.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,900,000.00	4.09
	其中：政策性金融债	49,900,000.00	4.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,048,000.00	2.46
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,249,927.20	0.10
8	同业存单	96,610,000.00	7.91
9	其他	-	-
10	合计	187,788,927.20	15.38

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	111711256	17 平安银行 CD256	1,000,000	96,610,000.00	7.91
2	170204	17 国开 04	500,000	49,900,000.00	4.09
3	011763016	17 首钢 SCP010	300,000	30,048,000.00	2.46
4	019557	17 国债 03	100,000	9,981,000.00	0.82
5	113013	国君转债	4,530	567,337.20	0.05

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。

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。

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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	02992	中国建筑国际股权	64	1.92	0.00

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

11.投资组合报告附注

（1）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，或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（2）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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,515.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	5,271,503.37
4	应收利息	2,636,221.63
5	应收申购款	56,914.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,968,154.77

（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）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。

（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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表

现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

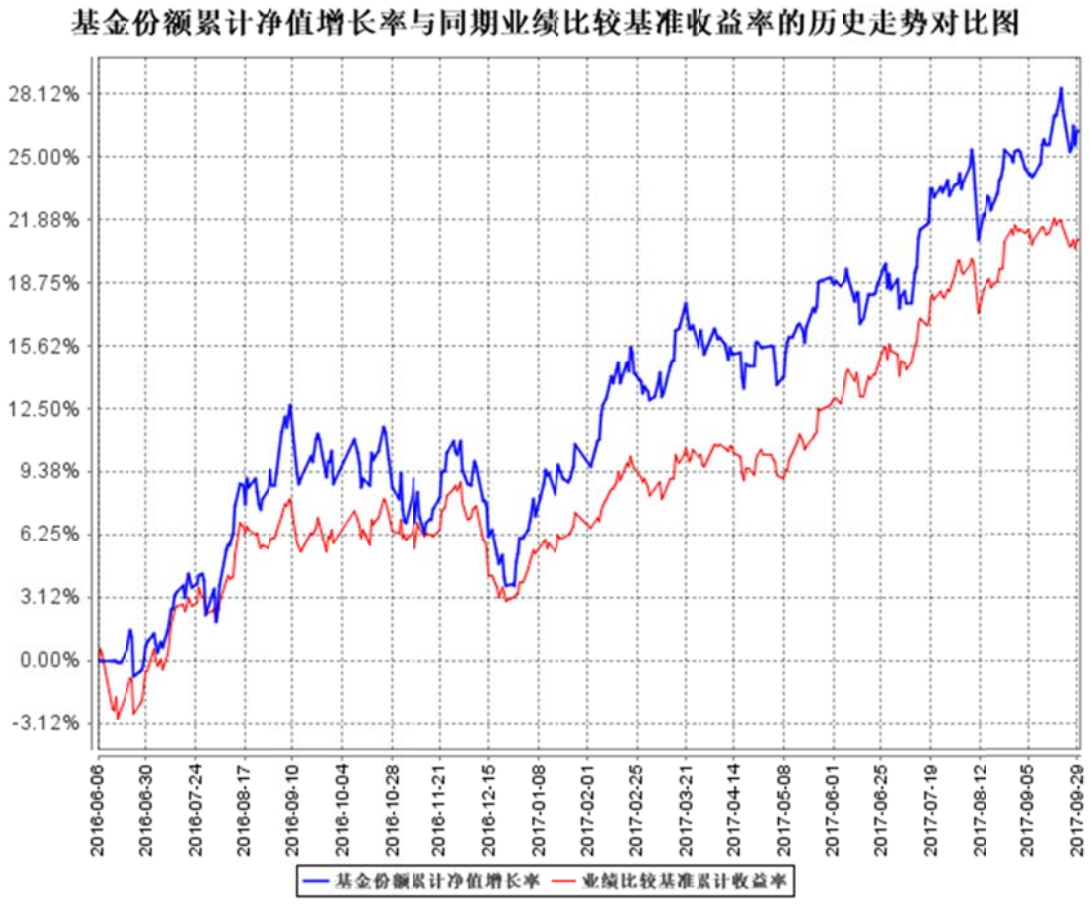
本基金合同生效日为 2016 年 6 月 6 日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

（一）历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

泰康沪港深精选灵活配置混合

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
基金合同生效日至2016年12月31日	6.10%	0.82%	3.90%	0.64%	2.20%	0.18%
2017年1月1日至2017年9月30日	19.07%	0.50%	16.38%	0.42%	2.69%	0.08%

（二）泰康沪港深精选灵活配置混合基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图（2016 年 6 月 6 日至 2017 年 9 月 30 日）



注：1、本基金基金合同于 2016 年 6 月 6 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。

十三、基金费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券、期货交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、基金的相关账户的开户及维护费用；

9、因投资相关规定范围内的香港联合交易所上市的股票而产生的各项合理费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0. 20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自本基金成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于本基金成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

上述“一、基金费用的种类中第 3－10 项费用”，根据有关法规及相应协议

规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

（一）“重要提示”部分，更新了招募说明书所载内容、有关财务数据和净值表现的截止日期。

（二）“三、基金管理人”部分对基金管理人主要人员情况进行了更新。

（三）“四、基金托管人”部分对基金托管人的信息进行了更新。

（四）“五、相关服务机构”部分对其他销售机构的信息进行了更新。

（五）“九、基金的投资”部分，对投资组合报告内容更新至 2017 年 9 月 30 日。

（六）“十一、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来至 2017 年 9 月 30 日的业绩，披露了历史走势对比图。

（七）“二十二、其他应披露事项”，对报告期内应披露的本基金相关事项进行了更新。

泰康资产管理有限责任公司

二〇一八年一月十九日