

泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券 投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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 托管人对本半年度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 所有者权益（基金净值）变动表	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	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 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 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的情况	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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	57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泰康沪港深价值优选混合
基金主代码	003580
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 29 日
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	122,721,446.83 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在内地与香港证券市场中优选具备估值优势或成长潜力的公司进行投资，在严控组合风险的基础上力争获取超越业绩比较基准的最大化投资收益。
投资策略	<p>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。</p> <p>大类资产配置方面，本基金综合分析宏观经济运行情况、宏观政策、股票市场与债券市场及其他替代资产市场的相对投资价值，在股票与债券等资产类别之间动态配置；根据 A 股、H 股溢价率的变化并综合市场行情，适当调整 A 股与港股的配置比例。</p> <p>股票市场投资方面，本基金主要采取价值型选股策略，综合考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，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。</p> <p>债券投资和流动性管理方面，本基金动态地确定并调整优先配置的资产类别和比例，综合平衡基金资产在流动性和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。</p>
业绩比较基准	恒生指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*5%+中债综合全价指数收益率*20%
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。
--	---

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		泰康资产管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	贺倩
	联系电话	010-58753683	010-66060069
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4001895522	95599
传真		010-57818785	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰 康国际大厦 5 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		段国圣	周慕冰

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、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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	泰康资产管理有限责任公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国 际大厦 5 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(2018 年 1 月 1 日 – 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1, 582, 340. 73
本期利润	-9, 406, 908. 75
加权平均基金份额本期利润	-0. 0765
本期加权平均净值利润率	-6. 36%
本期基金份额净值增长率	-6. 23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	16, 452, 834. 87
期末可供分配基金份额利润	0. 1341
期末基金资产净值	139, 174, 281. 70
期末基金份额净值	1. 1341
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	13. 41%

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) 本基金所述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。

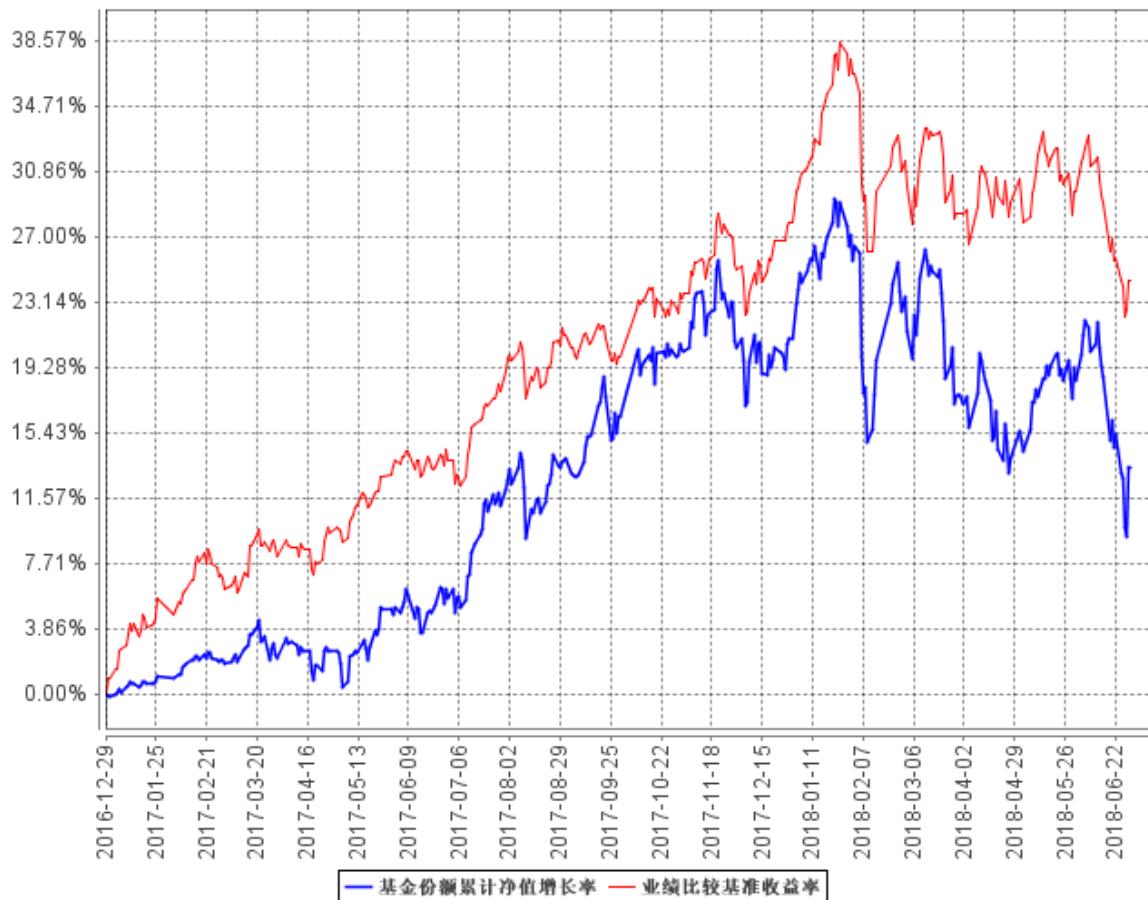
3.2 基金净值表现

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

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
过去一个月	-4. 95%	1. 53%	-4. 04%	0. 91%	-0. 91%	0. 62%
过去三个月	-3. 59%	1. 23%	-3. 10%	0. 88%	-0. 49%	0. 35%
过去六个月	-6. 23%	1. 28%	-2. 69%	0. 96%	-3. 54%	0. 32%
过去一年	7. 36%	1. 10%	9. 36%	0. 80%	-2. 00%	0. 30%
自基金合同生效起至今	13. 41%	0. 94%	24. 42%	0. 71%	-11. 01%	0. 23%

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

基金份额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 2016 年 12 月 29 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。

§ 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

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 2017 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 12000 亿元。除管理泰康委托资产外，泰康资产第三方业务总规模突破 6000 亿元，另类投资管理规模超过 3000 亿元，退休金管理规模超过 2000 亿元，是中国市场最大的退休金管理人之一。

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。截至 2018 年 6 月 30 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、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、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金共 25 只证券投资基金。

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		
刘伟	本基金基金经理	2017 年 5 月 4 日	-	7	刘伟于 2011 年 6 月加入泰康资产，历任风险管理部风险管理研究员、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。2018 年 2 月 6 日至今担任泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金基金经理。
黄成扬	本基金基金经理	2017 年 11 月 21 日	-	11	黄成扬于 2017 年 7 月加入泰康资产管理有限责任公司，现担任公募事业部投资部股票投资总监。2007 年 7 月至 2008 年 12 月在金捷基金担任研究部研究员，2009 年 1 月至 2012 年 2 月在恒星资产管理公司担任研究部研究员，2012 年 2 月至 2017 年 7 月在长盛基金国际业务部历任高级研究员、专户投资经理、基金经理。2015 年 7 月 21 日至 2017 年 7 月 14 日担任长盛环球景气行业大盘精选证券投资基金基金经理。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。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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 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

2018 年上半年，宏观经济走势平稳，结构上有所分化。1-5 月工业增加值累积同比 6.9%，较去年有所回升，冬季采暖限产导致企业加速赶工，生产较为旺盛。从三大需求来看，外需持续保持高位，出口表现强劲；消费一季度表现平稳，但二季度有所下滑；投资增速下滑明显，其中主要受到基建投资的影响，房地产和制造业投资仍然得以支撑。受到结构性去杠杆的影响，表外非标快速萎缩，社融增速有所下滑。货币政策有所调整，以对冲基本面下行的担忧，流动性也保持合理充裕。物价方面总体平稳，通胀压力不大。汇率方面，人民币先升后贬，总体变动不大。

权益市场方面，受到中美贸易摩擦的影响，同时国内信用紧缩导致的市场不确定性加剧，A 股和 H 股两市场均下行明显，恒生指数下跌 3.7%，上证综指下跌 13.90%。港股能源业、公用事业板块涨幅靠前，原材料、电讯业板块表现不佳。

具体操作层面，我们对于港股市场的操作思路逐渐倾向于防守反击，一方面抓盈利增长比较确定同时估值合理偏低的板块和个股，另一方面根据国家产业政策以及经济运行规律布局市场空间较大，处于较好成长轨道上的板块和个股；总体把控仓位，对消费医药增加了仓位配置，同时对一些基本面把握较大的消费电子和周期也仍然维持一定配置，及时累积绝对正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康沪港深价值优选基金份额净值为 1.1341 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.23%；同期业绩比较基准增长率为-2.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，基本面存在一定的下行压力，但在货币政策转向宽松、财政政策强调更加积极的政策组合下，下行的幅度总体可控。上半年社融增速下行向经济的传导作用，将会逐渐体现；居民的消费倾向受到房地产市场的挤压，消费增速也难以回升；外部环境受到中美贸易战的影响，不确定性也快速上升。但是，货币政策转向的政策思路将得以延续；财政政策下半年也有一定的发力空间。这一政策组合下，社融增速有望企稳，经济下行的压力可控。

股票市场方面，经过近期的大幅调整后，沪深 300 和恒生指数的估值都已经来到 10 年期均值以下，尤其是银行和地产的估值已经到了近几年的最低位。按照以往的经验，在出现较为明确的政策托底信号之后，股市往往会有一波反弹行情；但当前的市场环境下，由于政治局会议指示仍然维持“坚决遏制房价上涨”的决心，相对政策施展的空间不大，同时叠加了贸易战可能进一步发酵的情况，我们对于当前的市场维持一个偏中性的观点，需要密切关注政策下一步的动向和贸易战的进程。

在板块配置上，我们将更加偏好一些抗周期或者政府开支相关的板块，同时结合中报窗口寻找一些业绩明确改善的板块和个股，力争把握机会、规避风险，为基金持有人取得较好回报。

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。公司估值小组设成员若干名，成员由各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理中心公募运营部、公募投资部、监察稽核部、公募产品部等。估值小组成员均具有相关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，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，并经托管银行复核确认。

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，本报告期内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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—泰康资产管理有限责任公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，泰康资产管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，泰康资产管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,775,913.35	3,089,797.76
结算备付金		2,952,987.35	931,860.57
存出保证金		322,935.94	6,035.62
交易性金融资产	6.4.7.2	128,710,391.10	114,580,377.23
其中：股票投资		120,679,991.10	107,152,621.13
基金投资		—	—
债券投资		8,030,400.00	7,427,756.10
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,200,000.00	5,000,000.00
应收证券清算款		1,346,446.86	3,989,034.23
应收利息	6.4.7.5	71,142.94	164,649.88
应收股利		517,167.20	20,351.15
应收申购款		369,811.07	528,210.68
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		144,266,795.81	128,310,317.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		—	—
应付证券清算款		3,552,247.39	2,213,701.09
应付赎回款		1,097,624.74	207,719.67
应付管理人报酬		179,247.84	167,582.45
应付托管费		23,899.71	22,344.34
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	84,816.74	46,618.82
应交税费		—	—

应付利息			-	-465.81
应付利润			-	-
递延所得税负债			-	-
其他负债	6.4.7.8	154,677.69	139,145.15	
负债合计		5,092,514.11	2,796,645.71	
所有者权益:				
实收基金	6.4.7.9	122,721,446.83	103,770,114.66	
未分配利润	6.4.7.10	16,452,834.87	21,743,556.75	
所有者权益合计		139,174,281.70	125,513,671.41	
负债和所有者权益总计		144,266,795.81	128,310,317.12	

注: 报告截止日 2018 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.1341 元, 基金份额总额 122,721,446.83 份。

6.2 利润表

会计主体: 泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-7,327,198.26	12,452,017.36
1.利息收入		324,448.04	1,342,138.13
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	41,654.42	64,304.20
债券利息收入		125,160.62	177,836.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		157,633.00	1,099,997.80
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		3,242,971.04	4,786,711.89
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	2,010,900.25	3,588,244.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	181,243.40	25,865.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,050,827.39	1,172,602.48
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-10,989,249.48	5,905,612.28
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	94,632.14	417,555.06
减: 二、费用		2,079,710.49	2,182,617.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,098,740.47	1,321,979.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	146,498.75	176,263.86
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	691,584.54	460,442.62
5. 利息支出		465.81	13,900.86
其中：卖出回购金融资产支出		465.81	13,900.86
6. 税金及附加		1.73	—
7. 其他费用	6.4.7.20	142,419.19	210,030.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,406,908.75	10,269,400.13
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,406,908.75	10,269,400.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	103,770,114.66	21,743,556.75	125,513,671.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-9,406,908.75	-9,406,908.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	18,951,332.17	4,116,186.87	23,067,519.04
其中：1.基金申购款	53,419,474.49	11,745,042.22	65,164,516.71
2.基金赎回款	-34,468,142.32	-7,628,855.35	-42,096,997.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	122,721,446.83	16,452,834.87	139,174,281.70
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	223,112,505.88	-244,787.85	222,867,718.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,269,400.13	10,269,400.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-117,009,950.38	-4,038,957.75	-121,048,908.13
其中: 1.基金申购款	10,632,866.13	311,317.50	10,944,183.63
2.基金赎回款	-127,642,816.51	-4,350,275.25	-131,993,091.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	106,102,555.50	5,985,654.53	112,088,210.03

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:

段国圣

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

泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金(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[2016]第 2304 号《关于准予泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 223,046,249.46 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 223,112,505.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,256.42 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康资产管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

基金基金合同》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(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、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、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。本基金的业绩比较基准为：恒生指数收益 \times 75%+沪深 300 指数收益率 \times 5%+中债综合全价指数收益率 \times 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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 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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金管理费税政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2018年1月1日起，基金管理人运营基金产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率在基金资产中计提增值税，并由基金管理人缴纳。在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(2)对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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	2,775,913.35
定期存款	-
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	-
合计：	2,775,913.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	123,166,473.91	120,679,991.10	-2,486,482.81
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,016,000.00	14,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	8,016,000.00	14,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	131,182,473.91	128,710,391.10	-2,472,082.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,200,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	735.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	885.72
应收债券利息	71,250.41
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-1,888.09
应收申购款利息	7.90
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	151.11
合计	71,142.94

6.4.7.6 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	84,156.76
银行间市场应付交易费用	659.98
合计	84,816.74

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,669.72
预提费用	153,007.97
合计	154,677.69

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	103,770,114.66	103,770,114.66
本期申购	53,419,474.49	53,419,474.49
本期赎回(以"-"号填列)	-34,468,142.32	-34,468,142.32
本期末	122,721,446.83	122,721,446.83

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,746,699.54	7,996,857.21	21,743,556.75
本期利润	1,582,340.73	-10,989,249.48	-9,406,908.75
本期基金份额交易产生的变动数	2,573,249.25	1,542,937.62	4,116,186.87
其中：基金申购款	7,668,976.75	4,076,065.47	11,745,042.22
基金赎回款	-5,095,727.50	-2,533,127.85	-7,628,855.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,902,289.52	-1,449,454.65	16,452,834.87

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,528.58
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	16,424.70
其他	4,701.14

合计	41,654.42
----	-----------

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	281,563,784.38
减：卖出股票成本总额	279,552,884.13
买卖股票差价收入	2,010,900.25

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	181,243.40
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	181,243.40

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,749,897.65
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,344,634.32
减：应收利息总额	224,019.93
买卖债券差价收入	181,243.40

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期，本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,050,827.39
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,050,827.39

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-10,989,249.48
——股票投资	-10,920,527.70
——债券投资	-68,721.78
——资产支持证券投资	—
——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	-10,989,249.48

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	94,632.14
基金转换费收入	—
合计	94,632.14

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将赎回费全额计入基金财产；对持续持有期等于或长于 30 日、少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75%计入基金财产；对持续持有期等于或长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50%计入基金财产；对持续持有期等于或长于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25%计入基金财产。以上每个月按照 30 日计算。未计入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	691, 584. 54
银行间市场交易费用	—
合计	691, 584. 54

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	14, 876. 39
信息披露费	99, 131. 58
其他	600. 00
债券帐户维护费	18, 000. 00
银行费用	9, 811. 22
合计	142, 419. 19

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内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
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人股东
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

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

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,098,740.47	1,321,979.53
其中：支付销售机构的客户维护费	114,406.70	649,959.54

注：支付基金管理人泰康资产管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	146,498.75	176,263.86

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20% / 当年天数。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末，本基金管理人之外的其他关联方未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日	期末余额	2017年1月1日至2017年6月30日	当期利息收入
农业银行	2,775,913.35	20,528.58	2,123,298.21	28,822.19

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期，本基金无利润分配。

6.4.12 期末（2018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

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

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，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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在内地与香港证券市场中优选具备估值优势或成长潜力的公司进行投资，在严控组合风险的基础上力争获取超越业绩比较基准的最大化投资收益。

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，制订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行农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.0	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，并由债券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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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，并由债券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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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，并由债券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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	0.0	339,843.60
AAA 以下	0.00	688,023.30
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	1,027,866.90

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，并由债券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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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，并由债券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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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，并由债券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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值(同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算)不超过基金资产净值的 10%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券(同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算)，不超过该证券的 10%。本基金所持大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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所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(所有者权益)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

股票流动性方面，以 2018 年 6 月 30 日持仓为基础数据，假设股票交易的市场参与度为 5%，基金持仓的股票资产均可在 2 天内变现；在假设股票交易市场参与度为 5%，且市场成交量下跌 30% 的不利情况下，基金持仓的股票资产均可在 4 天内变现；公司旗下全部开放式基金持有一家上市公司发行的股票无超过该公司可流通股票的 15% 的情况。

债券流动性主要受信用风险影响，截止 2018 年 6 月 30 日，基金持仓债券均为高等级债券且未持仓市场负面资产，因此债券流动性较好。杠杆率压力测试方面，赎回比例 10% 的条件下(发生巨额赎回)，假设基金通过从市场融入资金来应对赎回，基金的杠杆率低于 40%。

基金流通受限资产比例为 0，5 日可变现资产比例不低于 90%。假设赎回比例 10% 的条件下(发生巨额赎回)，5 日可变现资产比例-投资者赎回比例均大于 0，基金流动性风险较低。

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银行存款、结算备付金、债券投资及资产支持证券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,775,913.35	—	—	—	2,775,913.35
结算备付金	2,952,987.35	—	—	—	2,952,987.35
存出保证金	322,935.94	—	—	—	322,935.94
交易性金融资产	8,030,400.00	—	—	120,679,991.10	128,710,391.10
买入返售金融资产	7,200,000.00	—	—	—	7,200,000.00
应收证券清算款	—	—	—	1,346,446.86	1,346,446.86
应收利息	—	—	—	71,142.94	71,142.94
应收股利	—	—	—	517,167.20	517,167.20
应收申购款	97,726.85	—	—	272,084.22	369,811.07
资产总计	21,379,963.49	—	—	122,886,832.32	144,266,795.81
负债					
应付证券清算款	—	—	—	3,552,247.39	3,552,247.39
应付赎回款	—	—	—	1,097,624.74	1,097,624.74
应付管理人报酬	—	—	—	179,247.84	179,247.84
应付托管费	—	—	—	23,899.71	23,899.71
应付交易费用	—	—	—	84,816.74	84,816.74
其他负债	—	—	—	154,677.69	154,677.69
负债总计	—	—	—	5,092,514.11	5,092,514.11
利率敏感度缺口	21,379,963.49	—	—	117,794,318.21	139,174,281.70
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2017 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	3,089,797.76	-	-	-	3,089,797.76
结算备付金	931,860.57	-	-	-	931,860.57
存出保证金	6,035.62	-	-	-	6,035.62
交易性金融资产	6,399,889.20	688,023.30	339,843.60	107,152,621.13	114,580,377.23
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	3,989,034.23	3,989,034.23
应收利息	-	-	-	164,649.88	164,649.88
应收股利	-	-	-	20,351.15	20,351.15
应收申购款	-	-	-	528,210.68	528,210.68
资产总计	15,427,583.15	688,023.30	339,843.60	111,854,867.07	128,310,317.12
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,213,701.09	2,213,701.09
应付赎回款	-	-	-	207,719.67	207,719.67
应付管理人报酬	-	-	-	167,582.45	167,582.45
应付托管费	-	-	-	22,344.34	22,344.34
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	46,618.82	46,618.82
应付利息	-	-	-	-465.81	-465.81
其他负债	-	-	-	139,145.15	139,145.15
负债总计	-	-	-	2,796,645.71	2,796,645.71
利率敏感度缺口	15,427,583.15	688,023.30	339,843.60	109,058,221.36	125,513,671.41

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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）	
	市场利率下调 0.25%	15,081.20	13,793.29
	市场利率上调 0.25%	-15,024.77	-13,674.07

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 83224745.88 元，未持有以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额为 83224745.88 元。

假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。若港币相对人民币汇率上升 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 832247.46 元；若港币相对人民币汇率下降 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-832247.46 元。

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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	120,679,991.10	86.71	107,152,621.13	85.37
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投	-	-	-	-

资产				
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	120,679,991.10	86.71	107,152,621.13	85.37

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数和恒生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 (2018 年 6 月 30 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
	沪深 300 上升 5%, 恒生指数上升 5%	8,337,188.51	6,444,922.49
	沪深 300 下降 5%, 恒生指数下降 5%	-8,337,188.51	-6,444,922.49

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 120,679,991.10 元, 属于第二层次的余额为 8,030,400.00 元, 无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日: 第一层次 107,109,094.13 元, 第二层次 7,471,283.10, 无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 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, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据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, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，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	120,679,991.10	83.65
	其中：股票	120,679,991.10	83.65
2	固定收益投资	8,030,400.00	5.57
	其中：债券	8,030,400.00	5.57
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	7,200,000.00	4.99
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	5,728,900.70	3.97
7	其他各项资产	2,627,504.01	1.82
8	合计	144,266,795.81	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 83,224,745.88 元，占期末资产净值比例为 59.80%。

7.2 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	27,119,466.32	19.49
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	675,600.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	1,822,578.90	1.31
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,018,000.00	1.45
J	金融业	—	—
K	房地产业	2,833,500.00	2.04
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2, 986, 100. 00	2. 15
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	37, 455, 245. 22	26. 91

7.2.2 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	7, 226, 853. 23	5. 19
B 消费者非必需品	13, 829, 895. 57	9. 94
C 消费者常用品	2, 177, 751. 05	1. 56
D 能源	2, 602, 606. 18	1. 87
E 金融	16, 794, 443. 44	12. 07
F 医疗保健	14, 101, 590. 84	10. 13
G 工业	6, 520, 086. 58	4. 68
H 信息技术	10, 651, 199. 97	7. 65
I 电信服务	1, 845, 724. 16	1. 33
J 公用事业	3, 631, 090. 66	2. 61
K 房地产	3, 843, 504. 20	2. 76
合计	83, 224, 745. 88	59. 80

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	占基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	17, 313	5, 748, 089. 13	4. 13
2	002236	大华股份	220, 000	4, 961, 000. 00	3. 56
3	01530	三生制药	325, 898	4, 894, 987. 96	3. 52
4	00906	中粮包装	1, 000, 000	4, 090, 000. 00	2. 94
5	600887	伊利股份	120, 000	3, 348, 000. 00	2. 41
6	002456	欧菲科技	200, 000	3, 226, 000. 00	2. 32
7	00753	中国国航	340, 640	2, 176, 689. 60	1. 56
7	601111	中国国航	110, 000	977, 900. 00	0. 70
8	03968	招商银行	118, 279	2, 887, 190. 39	2. 07
9	02186	绿叶制药	400, 000	2, 716, 000. 00	1. 95
10	002475	立讯精密	120, 000	2, 704, 800. 00	1. 94
11	00939	建设银行	429, 213	2, 622, 491. 43	1. 88
12	02688	新奥能源	38, 695	2, 517, 109. 75	1. 81
13	01177	中国生物制	229, 434	2, 328, 755. 10	1. 67

		药			
14	01336	新华保险	84,014	2,312,905.42	1.66
15	02382	舜宇光学科技	18,573	2,286,150.57	1.64
16	02318	中国平安	35,100	2,136,537.00	1.54
17	001979	招商蛇口	110,000	2,095,500.00	1.51
18	00512	远大医药	400,000	1,860,000.00	1.34
19	300347	泰格医药	30,000	1,856,100.00	1.33
20	01999	敏华控股	350,000	1,816,500.00	1.31
21	00522	ASM PACIFIC	20,000	1,672,800.00	1.20
22	01958	北京汽车	250,000	1,580,000.00	1.14
23	02001	新高教集团	250,000	1,527,500.00	1.10
24	01169	海尔电器	67,000	1,516,880.00	1.09
25	300232	洲明科技	150,000	1,482,000.00	1.06
26	002384	东山精密	60,000	1,440,000.00	1.03
27	01093	石药集团	71,933	1,437,221.34	1.03
28	01317	枫叶教育	120,000	1,430,400.00	1.03
29	00921	海信科龙	210,000	1,417,500.00	1.02
30	01114	BRILLIANCE CHI	117,944	1,408,251.36	1.01
31	00941	中国移动	23,744	1,395,197.44	1.00
32	300122	智飞生物	30,000	1,372,200.00	0.99
33	01055	中国南方航空股份	260,147	1,352,764.40	0.97
34	02689	玖龙纸业	159,000	1,340,370.00	0.96
35	01398	工商银行	266,184	1,317,610.80	0.95
36	600596	新安股份	80,000	1,293,600.00	0.93
37	01658	邮储银行	300,000	1,293,000.00	0.93
38	002281	光迅科技	60,000	1,272,000.00	0.91
39	03899	中集安瑞科	200,000	1,260,000.00	0.91
40	002402	和而泰	150,000	1,245,000.00	0.89
41	300450	先导智能	39,998	1,209,539.52	0.87
42	01918	融创中国	51,595	1,193,908.30	0.86
43	00168	青岛啤酒股份	32,000	1,162,880.00	0.84
44	002044	美年健康	50,000	1,130,000.00	0.81
45	00189	东岳集团	200,000	1,112,000.00	0.80
46	03988	中国银行	328,000	1,075,840.00	0.77
47	300036	超图软件	50,000	1,019,500.00	0.73

48	01569	民生教育	600,000	990,000.00	0.71
49	00883	中国海洋石油	84,865	969,158.30	0.70
50	000651	格力电器	20,000	943,000.00	0.68
51	600029	南方航空	99,962	844,678.90	0.61
52	000002	万科 A	30,000	738,000.00	0.53
53	002035	华帝股份	30,000	732,900.00	0.53
54	00386	中国石油化工股份	114,672	677,711.52	0.49
55	603368	柳药股份	20,000	675,600.00	0.49
56	02669	中海物业	300,000	657,000.00	0.47
57	000938	紫光股份	10,000	626,000.00	0.45
58	02678	天虹纺织	60,000	598,800.00	0.43
59	03908	中金公司	50,000	589,500.00	0.42
60	02628	中国人寿	31,555	538,643.85	0.39
61	002439	启明星辰	25,000	530,500.00	0.38
62	603788	宁波高发	19,940	491,321.60	0.35
63	00857	中国石油股份	95,322	479,469.66	0.34
64	300047	天源迪科	30,000	468,000.00	0.34
65	300357	我武生物	9,960	397,105.20	0.29
66	02007	碧桂园	32,595	379,079.85	0.27
67	00688	中国海外发展	17,213	375,071.27	0.27
68	000860	顺鑫农业	10,000	375,000.00	0.27
69	02601	中国太保	14,564	372,692.76	0.27
70	02018	瑞声科技	4,000	372,640.00	0.27
71	02313	申洲国际	4,538	370,527.70	0.27
72	00175	吉利汽车	18,883	324,032.28	0.23
73	01109	华润置地	12,883	287,290.90	0.21
74	01088	中国神华	15,006	235,594.20	0.17
75	02319	蒙牛乳业	10,244	229,772.92	0.17
76	01044	恒安国际	3,581	227,930.65	0.16
77	00267	中信股份	23,533	219,327.56	0.16
78	02328	中国财险	30,471	217,562.94	0.16
79	00914	海螺水泥	5,637	213,867.78	0.15
80	03333	中国恒大	12,620	212,773.20	0.15
81	00762	中国联通	25,400	209,804.00	0.15
82	02020	安踏体育	5,866	205,485.98	0.15

83	00291	华润啤酒	6,000	192,720.00	0.14
84	00384	中国燃气	6,768	180,028.80	0.13
85	03328	交通银行	34,724	176,050.68	0.13
86	00728	中国电信	56,208	173,682.72	0.12
87	01193	华润燃气	6,000	172,020.00	0.12
88	00270	粤海投资	15,719	165,206.69	0.12
89	00586	海螺创业	6,500	157,300.00	0.11
90	00322	康师傅控股	10,000	153,400.00	0.11
91	01211	比亚迪股份	3,760	150,738.40	0.11
92	02269	药明生物	2,000	147,280.00	0.11
93	01099	国药控股	5,444	144,810.40	0.10
94	00836	华润电力	12,000	139,800.00	0.10
95	02202	万科企业	5,933	137,289.62	0.10
96	06030	中信证券	9,924	131,195.28	0.09
97	00998	中信银行	31,000	128,340.00	0.09
98	00966	中国太平	6,136	127,015.20	0.09
99	00656	复星国际	10,117	125,855.48	0.09
100	01988	民生银行	26,000	122,980.00	0.09
101	00151	中国旺旺	20,446	120,222.48	0.09
102	01800	中国交通建设	18,509	118,272.51	0.08
103	00981	中芯国际	13,500	116,100.00	0.08
104	00241	阿里健康	18,000	114,840.00	0.08
105	00489	东风集团股份	16,000	112,000.00	0.08
106	00392	北京控股	3,419	110,125.99	0.08
107	00992	联想集团	30,299	108,470.42	0.08
108	00696	中国民航信息网络	5,598	107,817.48	0.08
109	00144	招商局港口	8,000	107,520.00	0.08
110	03323	中国建材	16,000	104,800.00	0.08
111	00960	龙湖地产	5,846	104,234.18	0.07
112	01766	中国中车	20,000	102,600.00	0.07
113	00257	中国光大国际	11,531	98,590.05	0.07
114	02238	广汽集团	14,935	96,629.45	0.07
115	03888	金山软件	4,772	95,774.04	0.07
116	00371	北控水务集团	26,249	94,758.89	0.07
117	00867	康哲药业	7,072	93,491.84	0.07

118	02196	复星医药	2, 534	91, 984. 20	0. 07
119	06808	高鑫零售	10, 500	90, 825. 00	0. 07
120	03383	雅居乐集团	8, 000	90, 080. 00	0. 06
121	00902	华能国际电力股份	20, 120	88, 125. 60	0. 06
122	01339	中国人民保险集团	28, 000	87, 080. 00	0. 06
123	00813	世茂房地产	5, 000	86, 850. 00	0. 06
124	01171	兖州煤业股份	10, 000	86, 500. 00	0. 06
125	00390	中国中铁	17, 269	86, 172. 31	0. 06
126	06837	海通证券	12, 561	84, 033. 09	0. 06
127	00135	昆仑能源	14, 000	81, 060. 00	0. 06
128	06886	HTSC	7, 495	78, 847. 40	0. 06
129	03311	中国建筑国际	11, 536	78, 329. 44	0. 06
130	02338	潍柴动力	8, 482	77, 355. 84	0. 06
131	03993	洛阳钼业	24, 000	76, 800. 00	0. 06
132	02799	中国华融	39, 000	74, 490. 00	0. 05
133	01359	中国信达	35, 000	74, 200. 00	0. 05
134	00148	建滔化工	3, 051	73, 834. 20	0. 05
135	01816	中广核电力	43, 000	73, 530. 00	0. 05
136	01548	金斯瑞生物科技	4, 000	73, 200. 00	0. 05
137	02883	中海油田服务	11, 698	73, 112. 50	0. 05
138	00817	中国金茂	22, 000	73, 040. 00	0. 05
139	00165	中国光大控股	6, 000	72, 840. 00	0. 05
140	03898	中车时代电气	2, 303	72, 429. 35	0. 05
141	00552	中国通信服务	16, 000	67, 040. 00	0. 05
142	00338	上海石油化工股份	16, 393	66, 063. 79	0. 05
143	02607	上海医药	3, 600	65, 700. 00	0. 05
144	01186	中国铁建	9, 777	65, 505. 90	0. 05
145	03606	福耀玻璃	2, 845	63, 557. 30	0. 05
146	02333	长城汽车	12, 553	63, 518. 18	0. 05
147	00177	江苏宁沪高速公路	8, 000	63, 040. 00	0. 05

148	01882	海天国际	4,000	62,440.00	0.04
149	00358	江西铜业股份	7,362	62,061.66	0.04
150	00363	上海实业控股	4,000	61,640.00	0.04
151	00884	旭辉控股集团	14,000	58,940.00	0.04
152	02777	富力地产	4,400	58,740.00	0.04
153	01060	阿里影业	80,000	58,400.00	0.04
153	02600	中国铝业	20,000	58,400.00	0.04
154	03360	远东宏信	9,000	57,780.00	0.04
155	01066	威高股份	12,000	56,160.00	0.04
156	00694	北京首都机场股份	8,000	55,760.00	0.04
157	02899	紫金矿业	22,000	55,660.00	0.04
158	01776	广发证券	5,724	55,236.60	0.04
159	02357	中航科工	14,000	55,160.00	0.04
160	03320	华润医药	6,000	54,960.00	0.04
161	06881	中国银河	15,661	53,247.40	0.04
162	00576	浙江沪杭甬	8,839	52,150.10	0.04
163	00916	龙源电力	9,278	49,451.74	0.04
164	02314	理文造纸	7,000	46,830.00	0.03
165	01199	中远海运港口	8,000	44,080.00	0.03
166	03618	重庆农村商业银行	11,000	43,340.00	0.03
167	03377	远洋集团	11,000	42,240.00	0.03
168	00958	华能新能源	18,606	40,933.20	0.03
169	06818	中国光大银行	14,000	39,760.00	0.03
170	01316	耐世特	4,000	39,120.00	0.03
171	06098	碧桂园服务	4,206	35,666.88	0.03
172	00285	比亚迪电子	3,500	31,675.00	0.02
173	00493	国美零售	43,000	28,810.00	0.02
174	03800	保利协鑫能源	46,000	28,520.00	0.02
175	00410	S O H O 中国	9,000	28,260.00	0.02
176	02727	上海电气	12,000	26,760.00	0.02
177	00005	汇丰控股	384	23,827.20	0.02

178	00020	会德丰	500	23,040.00	0.02
179	00460	四环医药	15,000	22,200.00	0.02
180	02282	美高梅中国	1,133	17,380.22	0.01
181	00669	创科实业	350	12,911.50	0.01
182	03969	中国通号	479	2,251.30	0.00
183	00354	中国软件国际	423	2,182.68	0.00
184	00268	金蝶国际	318	2,152.86	0.00
185	01980	天鸽互动	372	1,826.52	0.00
186	01097	有线宽频	9,532	953.20	0.00
187	01888	建滔积层板	77	629.09	0.00
188	01157	中联重科	122	344.04	0.00
189	03958	东方证券	40	206.00	0.00
190	00777	网龙	11	160.82	0.00
191	00968	信义光能	62	125.86	0.00

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	00700	腾讯控股	8,130,080.89	6.48
2	002600	领益智造	7,810,303.00	6.22
3	002236	大华股份	6,911,980.16	5.51
4	02018	瑞声科技	6,848,896.50	5.46
5	01530	三生制药	6,343,632.90	5.05
6	002456	欧菲科技	4,811,427.00	3.83
7	00906	中粮包装	4,674,236.75	3.72
8	002475	立讯精密	4,635,833.00	3.69
9	02689	玖龙纸业	4,416,446.66	3.52
10	01055	中国南方航空股份	4,083,318.82	3.25
11	600887	伊利股份	4,051,519.00	3.23
12	00753	中国国航	3,850,913.65	3.07
13	01336	新华保险	3,702,140.77	2.95
14	000002	万科 A	3,475,569.00	2.77
15	00939	建设银行	3,470,740.39	2.77

16	000333	美的集团	3,403,542.00	2.71
17	001979	招商蛇口	3,236,776.00	2.58
18	01114	BRILLIANCE CHI	3,160,724.73	2.52
19	01569	民生教育	3,157,723.19	2.52
20	02318	中国平安	3,059,160.29	2.44
21	01999	敏华控股	3,051,465.95	2.43
22	02382	舜宇光学科技	2,984,173.42	2.38
23	000651	格力电器	2,965,001.75	2.36
24	02186	绿叶制药	2,940,979.24	2.34
25	01958	北京汽车	2,937,643.89	2.34
26	002402	和而泰	2,896,620.00	2.31
27	02601	中国太保	2,889,052.37	2.30
28	600172	黄河旋风	2,750,175.00	2.19
29	06088	FIT HON TENG	2,697,774.67	2.15
30	02328	中国财险	2,608,821.65	2.08
31	002384	东山精密	2,535,175.00	2.02

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	00700	腾讯控股	10,897,341.76	8.68
2	02018	瑞声科技	9,263,187.43	7.38
3	002600	领益智造	8,529,836.00	6.80
4	00939	建设银行	7,055,671.21	5.62
5	01398	工商银行	6,125,982.85	4.88
6	02382	舜宇光学科技	5,429,617.14	4.33
7	00966	中国太平	4,126,365.95	3.29
8	01055	中国南方航空股份	4,126,004.54	3.29
9	02328	中国财险	3,453,394.03	2.75
10	03618	重庆农村商业银行	3,414,662.50	2.72
11	000333	美的集团	3,223,300.00	2.57
12	01336	新华保险	3,183,876.85	2.54
13	02601	中国太保	3,167,462.83	2.52
14	002236	大华股份	3,159,125.00	2.52

15	02318	中国平安	3,030,468.12	2.41
16	02689	玖龙纸业	2,999,030.34	2.39
17	01728	正通汽车	2,786,699.97	2.22
18	000651	格力电器	2,668,910.00	2.13
19	002563	森马服饰	2,529,203.27	2.02
20	600172	黄河旋风	2,513,901.00	2.00

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	304,000,781.80
卖出股票收入(成交)总额	279,552,884.13

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	8,030,400.00	5.77
	其中:政策性金融债	8,030,400.00	5.77
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	8,030,400.00	5.77

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	018005	国开 1701	80,000	8,030,400.00	5.77

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 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

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的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

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。

7.12.3 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	322,935.94
2	应收证券清算款	1,346,446.86
3	应收股利	517,167.20
4	应收利息	71,142.94
5	应收申购款	369,811.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,627,504.01

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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

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
2,926	41,941.71	56,733,978.42	46.23%	65,987,468.41	53.77%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	418,566.26	0.3411%

8.3 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的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年12月29日）基金份额总额	223,112,505.88
本报告期期初基金份额总额	103,770,114.66
本报告期基金总申购份额	53,419,474.49
减：本报告期基金总赎回份额	34,468,142.32
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	122,721,446.83

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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
国泰君安	2	273,736,489.08	46.75%	78,188.23	46.70%	-
光大证券	2	120,230,243.60	20.53%	34,371.94	20.53%	-
中金公司	2	89,408,724.49	15.27%	25,419.77	15.18%	-
广发证券	2	41,545,654.40	7.10%	12,030.44	7.18%	-
方正证券	2	22,004,700.23	3.76%	6,472.09	3.87%	-
天风证券	2	19,848,130.45	3.39%	5,728.70	3.42%	-
安信证券	2	18,765,873.93	3.20%	5,228.03	3.12%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

申万宏源	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	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

券商选择标准：协议券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，即参选券商应满足以下条件：

(1) 经营业务比较全面，能够覆盖证券经纪、证券研究、投资银行、股指期货和融资融券等领域；
 (2) 拥有独立的研究部门及 20 人以上的研究团队，研究范围覆盖宏观经济、金融市场和相关行业，并且已建立完善的研究报告质量保障机制；(3) 投资银行实力较强，能够提供优质服务；(4) 建立相关业务利益冲突防范机制，完善隔离墙制度，确保研究、投行服务客观公正；(5) 承诺接受中国证监会、保监会有关保险机构证券交易情况的监督，并履行本通知规定的相关要求和报告义务；(6) 经评估符合向基金机构和保险机构投资提供交易单元的条件并经获准；(7) 符合中国证监会、保监会规定的其他条件。除以上首要基本标准外，参选的券商还应当满足以下三个方面的要求：(1) 公司财务状况良好，近一年内无重大违规事项；(2) 在国内及海外市场拥有较高的市场声誉；(3) 能够提供全方位的业务支持，包括但不仅限于、股指期货、融资融券、海外投资、QFII 等业务方面的咨询意见。

券商选择程序：(1) 公募集中交易室负责组织定期比选工作，根据公募事业部制定的规则和需求选择券商，并对符合规定的券商发出邀请函；(2) 券商有权决定是否参选，参选的券商应在规定时间内回复邀请函，未在规定时间内回复邀请函的券商视为放弃参选；(3) 参选券商应根据邀请函的要求提供参选方案，并根据公募事业部安排完成现场评述、现场答疑等基本程序；(4) 公募事业部应本着公平客观的原则，从承担投资、研究等职能的相关岗位中抽取相关专业人员形成评审小组，评审小组根据评价要素、分工范围，对参选券商进行评分。公募集中交易室负责汇总打分，并根据各项权重计算评价结果；评审小组成员包括以下业务骨干：基金经理、研究员、信评研究员、股票交易员等承担投资、研究职能的相关专业人员。(5) 为保证评选的客观性、公正性，公募合规岗应全程参加现场评选，并监督评选全过程。公募合规岗有权对妨碍客观、公正原则的行为予以制止和纠正；(6) 公募集中交易室将协议券商的评选结果和拟定的协议券商的交易单元租用计划在办公系统中以呈批件的形式，报送参评人员会签，部门负责人审批；(7) 待呈批件审批通过后，运营管理部负责与协议券商签订《证券交易单元租用协议》、办理交易单元联通及相关

账户报备等工作；（8）公募集中交易室负责与协议券商签订《证券研究综合服务协议》；（9）信息管理部负责对交易单元进行测试；（10）定期比选方式选择的协议券商将纳入公募事业部佣金分配体系，根据公募事业部对其的定期评价打分结果，在租用的交易单元上实现交易佣金的合理分配；（11）定期比选原则上三年一次。

3、本报告期内本基金新增租用 2 个交易单元，为东兴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

10.7.2 基金租用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	
	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例
国泰君安	9,128,285.34	100.00%	402,600,000.00	45.96%	-	-
光大证券	-	-	167,800,000.00	19.16%	-	-
中金公司	-	-	162,100,000.00	18.50%	-	-
广发证券	-	-	51,100,000.00	5.83%	-	-
方正证券	-	-	3,500,000.00	0.40%	-	-
天风证券	-	-	30,900,000.00	3.53%	-	-
安信证券	-	-	58,000,000.00	6.62%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	泰康资产管理有限责任公司关于调整大泰金石基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 2 月 2 日
2	泰康资产管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金开通在上海华信证券有限责任公司基金转换业务并参加其基金转换费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 2 月 6 日

	活动的公告		
3	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年2月7日
4	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金2018年“春节”期间暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年2月9日
5	泰康资产管理有限责任公司关于调整上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年2月28日
6	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加上海有鱼基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年3月2日
7	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加南京途牛金融信息服务有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年3月6日
8	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金2018年“耶稣受难节、复活节、清明节”期间暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年3月28日
9	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年3月31日
10	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金2018年“劳动节”期间暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年4月24日
11	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金2018年“香港佛诞日”期间暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年5月19日
12	泰康资产管理有限责任公司关于调整中国银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年5月28日

13	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2018 年“香港特别行政区成立纪念日翌日”期间暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 6 月 29 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

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	20180101-20180630	34,315,284.35	16,533,564.81	-	50,848,849.16	41.43%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当本基金出现单一持有者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。							

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沪港深价值优选混合型证券投资基金注册的文件;
- (二) 《泰康沪港深价值优选混合型证券投资基金基金合同》;
- (三) 《泰康沪港深价值优选混合型证券投资基金招募说明书》;
- (四) 《泰康沪港深价值优选混合型证券投资基金托管协议》。

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》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录基金管理人互联网网址（<http://www.tkfunds.com.cn>）查阅。

泰康资产管理有限责任公司

2018 年 8 月 27 日