

# 泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 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 | 101,709,616.06 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 and 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       |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                    |
|----------------------|--------------------|
| 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  |

### § 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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 8,369,341.48                           |
| 本期利润          | 19,085,282.41                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1783                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 18.27%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2019 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0527                                 |
| 期末基金资产净值      | 113,219,669.84                         |
| 期末基金份额净值      | 1.1132                                 |

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。

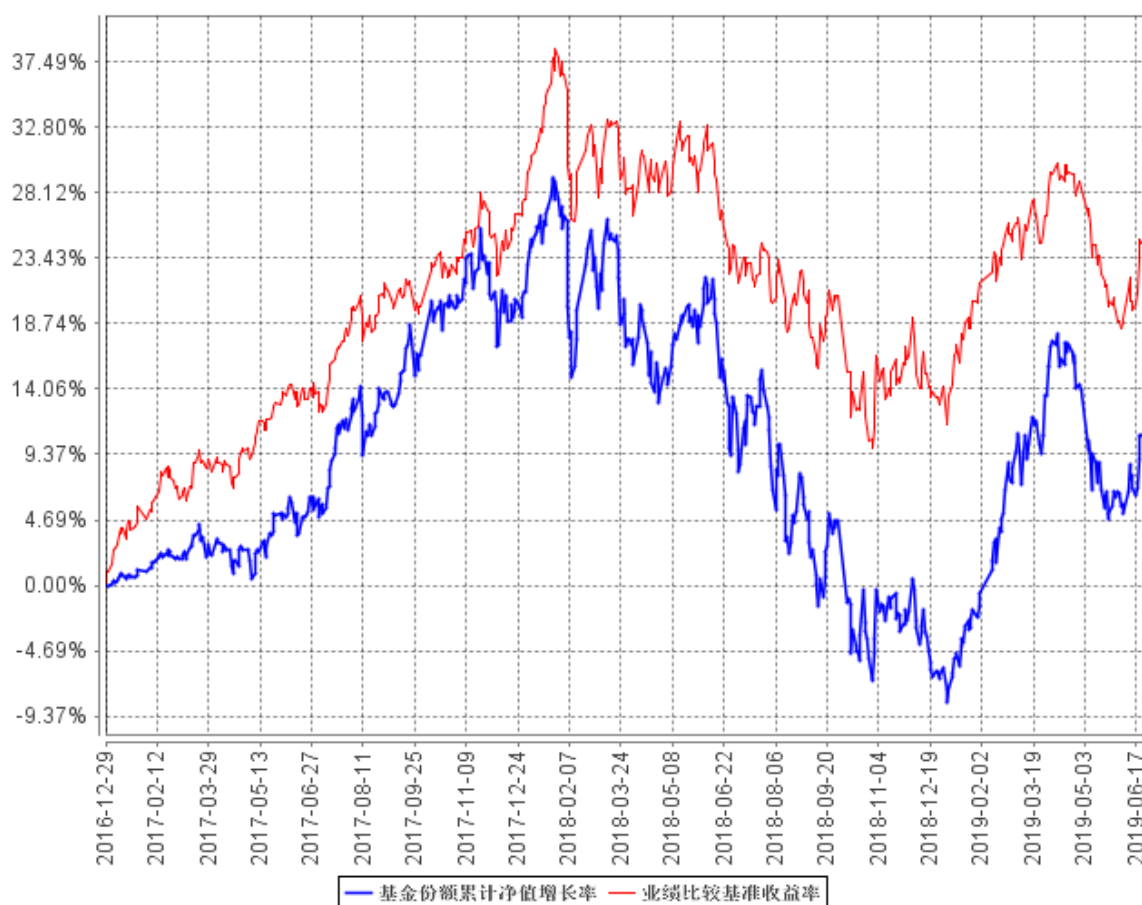
#### 3.2 基金净值表现

##### 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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去一个月          | 4.29%        | 0.95%               | 4.90%              | 0.82%                 | -0.61%  | 0.13% |
| 过去三个月          | -2.01%       | 1.11%               | -1.36%             | 0.74%                 | -0.65%  | 0.37% |
| 过去六个月          | 18.27%       | 1.08%               | 9.22%              | 0.77%                 | 9.05%   | 0.31% |
| 过去一年           | -1.84%       | 1.26%               | 0.24%              | 0.92%                 | -2.08%  | 0.34% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 11.32%       | 1.08%               | 24.73%             | 0.80%                 | -13.41% | 0.28% |

### 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 2018 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 14000 亿元。除管理泰康委托的资产外，泰康资产管理的第三方业务总规模突破 7500 亿元，另类投资管理规模超过 3300 亿元。目前泰康资产退休金管理规模超过 2800 亿元，其中企业年金管理规模超过 2300 亿元，是国内最大的企业年金投资管理人。

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 2019 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、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康安业政策性金融债债券型证券投资基金共 35 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 黄成扬 | 本基金基金经理 | 2017 年 11 月 21 日 | —    | 12     | 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。2018 年 12 月 21 日至今担任泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 1 月 29 日至今担任泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 3 日至今担任泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 9 日至今担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 16 日至今担任泰康港股通中证香港银行投资 |



|    |         |                |   |   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|----|---------|----------------|---|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |         |                |   |   | 指数型发起式证券投资基金基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 刘伟 | 本基金基金经理 | 2017 年 5 月 4 日 | - | 8 | 刘伟于 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。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。2018 年 12 月 21 日至今担任泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 1 月 29 日至今担任泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 3 日至今担任泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 9 日至今担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 16 日至今担任泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式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 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

宏观经济方面，2019 年上半年经济平稳中小幅下滑，总体下行压力可控。出口的增速受到外需走弱、全球贸易割裂的影响有所下滑，是上半年经济较大的拖累项；同时，制造业投资受到出口的影响表现较弱，从而拖累总体投资增速有所下行。但消费增速受益于居民可支配收入的提升而有所上行，对经济形成支撑。通胀方面呈现了 CPI 向上、PPI 向下的格局。货币条件方面，M2 保持稳定；社融受益于宽信用政策的传导而明显改善；汇率则先升值后贬值，总体稳定。

权益市场方面，一季度全球股市普涨，A 股市场大幅领先，港股市场相对滞后。我们认为股市上涨的主要原因来自于投资者心态的转变：包括对于经济前景和经济转型的看法从极度悲观转为相对中性乃至乐观，同时中美贸易谈判也随着中美不断互访取得了切实的进展和美联储停止加息进程，也似乎让投资者感觉到全球经济在通向衰退的道路上有所止步。进入二季度中美贸易谈判再度出现波折，虽然在 6 月底的 G20 峰会上两国领导人再度会面定下重启谈判，但仍然给全球的经济前景增加些许阴影。同时全球货币宽松的预期再度高启，投资者希望全球的央行来提振经济，但这一次宽松的力度能有多大，对于经济的刺激能有多强，仍然有待评定。从数据和板块上看，上半年从上证综指上涨 19.45%，沪深 300 上涨 27.07%，恒生指数上涨 10.43%，其中港股消费品与建筑地产行业涨幅靠前，港股原材料、电讯、能源等行业表现不佳。

具体操作层面，我们通过对于经济和企业盈利增速评估，更多的聚焦在国内经济基本面和宏观政策的变化上，对整体和行业估值水平进行综合考量，整体仓位有所提升。在板块配置上，本

基金仍保持以估值仍然很低的金融地产为基础，注意把握具备韧性的大消费，和符合国家经济转型的 TMT 板块。

#### 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 1.1132 元,本报告期基金份额净值增长率为 18.27%; 同期业绩比较基准增长率为 9.22%。

#### 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 2019 年下半年，基本面下行的压力没有完全释放，但预计下行斜率缓慢。全球贸易环境割裂、外需维持低位，对出口的造成负面影响；同时地产投资随着前期拿地和新开工的下行，地产资金链边际趋紧，也将步入下行通道，但另一方面，基建投资有望形成对冲，消费在汽车缓慢复苏的背景下也有所支持。政策上将在稳增长和防风险之间保持平衡和灵活性，财政政策继续落实减税降费、盘活存量；货币政策将保持流动性合理充裕，同时加速推进利率市场化改革，引导实际贷款利率的下行。

权益市场方面，2019 年以来，国内宏观经济数据虽然有所下滑，但整体韧性仍在，海外特别是美国的宏观数据亦呈现缓慢回落的态势，市场的博弈点更为侧重各大央行的货币政策以及各国的财政政策。展望下半年，关于政策的博弈仍将持续，但困难在于市场已经在一定程度上反应了宽松的预期。

行业选择层面，我们认为大金融和大地产板块的基本面仍然相对较高，同时由于对于政策预期不高，目前的估值仍在相对低位，总体仍然较有吸引力。同时我们亦注重从下至上的去寻找消费医药及公用事业等板块中兼具长期成长前景和短期消费黏性的个股。

#### 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，设有公募估值小组，并制定了相关制度及流程。公司公募估值小组设成员若干名，成员由公募各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理部、投资部、监察稽核部等。公募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，本基金管理人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合规守信情况声明

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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合规守信、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，未发现有关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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                                |                                  |
| 银行存款            | 5,420,153.08                   | 6,130,458.77                     |
| 结算备付金           | 2,743,150.60                   | 4,747,830.23                     |
| 存出保证金           | 429,703.33                     | 190,833.15                       |
| 交易性金融资产         | 100,830,598.88                 | 87,063,852.97                    |
| 其中：股票投资         | 92,263,517.48                  | 78,197,404.87                    |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 8,567,081.40                   | 8,866,448.10                     |
| 资产支持证券投资        | -                              | -                                |
| 贵金属投资           | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 3,000,000.00                   | 8,900,000.00                     |
| 应收证券清算款         | 1,140,618.14                   | -                                |
| 应收利息            | 129,740.95                     | 234,257.21                       |
| 应收股利            | 539,738.83                     | 21,368.47                        |
| 应收申购款           | 1,788.83                       | -                                |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| 资产总计            | 114,235,492.64                 | 107,288,600.80                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |                                |                                  |
| 短期借款            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         | 453,665.25                     | 1,900,010.28                     |
| 应付赎回款           | 261,378.29                     | -                                |
| 应付管理人报酬         | 136,536.58                     | 138,848.26                       |
| 应付托管费           | 18,204.86                      | 18,513.09                        |
| 应付销售服务费         | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 56,472.12                      | 81,441.89                        |
| 应交税费            | 1.00                           | 1,264.22                         |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 应付利息          | -              | -              |
| 应付利润          | -              | -              |
| 递延所得税负债       | -              | -              |
| 其他负债          | 89,564.70      | 49,000.00      |
| 负债合计          | 1,015,822.80   | 2,189,077.74   |
| <b>所有者权益：</b> |                |                |
| 实收基金          | 101,709,616.06 | 111,670,099.48 |
| 未分配利润         | 11,510,053.78  | -6,570,576.42  |
| 所有者权益合计       | 113,219,669.84 | 105,099,523.06 |
| 负债和所有者权益总计    | 114,235,492.64 | 107,288,600.80 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1132 元，基金份额总额 101,709,616.06 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           | 20,718,180.96                            | -7,327,198.26                                 |
| 1.利息收入                | 226,367.93                               | 324,448.04                                    |
| 其中：存款利息收入             | 60,830.19                                | 41,654.42                                     |
| 债券利息收入                | 119,353.15                               | 125,160.62                                    |
| 资产支持证券利息收入            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            | 46,184.59                                | 157,633.00                                    |
| 其他利息收入                | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | 9,763,927.01                             | 3,242,971.04                                  |
| 其中：股票投资收益             | 8,900,541.36                             | 2,010,900.25                                  |
| 基金投资收益                | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 52,669.85                                | 181,243.40                                    |
| 资产支持证券投资收益            | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | -31,860.00                               | -                                             |
| 股利收益                  | 842,575.80                               | 1,050,827.39                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 10,715,940.93                            | -10,989,249.48                                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 11,945.09                                | 94,632.14                                     |
| <b>减：二、费用</b>         | 1,632,898.55                             | 2,079,710.49                                  |
| 1. 管理人报酬              | 850,418.10                               | 1,098,740.47                                  |
| 2. 托管费                | 113,389.04                               | 146,498.75                                    |
| 3. 销售服务费              | -                                        | -                                             |

|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 4. 交易费用             | 562,235.67    | 691,584.54    |
| 5. 利息支出             | -             | 465.81        |
| 其中：卖出回购金融资产支出       | -             | 465.81        |
| 6. 税金及附加            | 0.86          | 1.73          |
| 7. 其他费用             | 106,854.88    | 142,419.19    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 19,085,282.41 | -9,406,908.75 |
| 减：所得税费用             | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | 19,085,282.41 | -9,406,908.75 |

### 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 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）                        | 111,670,099.48                             | -6,570,576.42 | 105,099,523.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | 19,085,282.41 | 19,085,282.41  |
| 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）      | -9,960,483.42                              | -1,004,652.21 | -10,965,135.63 |
| 其中：1.基金申购款                             | 4,817,258.52                               | 400,126.73    | 5,217,385.25   |
| 2.基金赎回款                                | -14,777,741.94                             | -1,404,778.94 | -16,182,520.88 |
| 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）                        | 101,709,616.06                             | 11,510,053.78 | 113,219,669.84 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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 |

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：

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| _____<br>段国圣 | _____<br>金志刚 | _____<br>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%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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 x75%+沪深 300 指数收益率 x5%+中债综合全价指数收益率 x20%。

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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

### 6.4.5.1 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[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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管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% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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/深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/深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/深港通买卖、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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构        |
| 泰康保险集团股份有限公司 | 管理人的控股股东            |

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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 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。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|----|----------------------------------|--------------------------------------------|
|----|----------------------------------|--------------------------------------------|

|                 | 30 日       |              |
|-----------------|------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 850,418.10 | 1,098,740.47 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 72,192.51  | 114,406.70   |

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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 113,389.04                 | 146,498.75                      |

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。

#### 6.4.8.3 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。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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。

##### 6.4.8.4.2 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。

#### 6.4.8.5 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |           |
|-------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 农业银行  | 5,420,153.08               | 30,398.99 | 2,775,913.35                    | 20,528.58 |

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。

**6.4.8.6 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。

**6.4.8.7 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。

**6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |                |          |       |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|-----------------|----------------|----------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 可流通日           | 流通受限类型   | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 300788               | 中信出版 | 2019 年 6 月 27 日 | 2019 年 7 月 5 日 | 网下新股流通受限 | 14.85 | 14.85  | 1,556    | 23,106.60 | 23,106.60 | -  |
| 601236               | 红塔证券 | 2019 年 6 月 27 日 | 2019 年 7 月 5 日 | 网上新股流通受限 | 3.46  | 3.46   | 1,000    | 3,460.00  | 3,460.00  | -  |

注：截至本报告期末 2019 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债券。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 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。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 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。

**6.4.10 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 2019 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 92,236,950.88 元，属于第二层次的余额为 8,593,648.00 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 78,197,404.87 元，第二层次 8,866,448.10 元，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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2019 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(2018 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              | 92,263,517.48  | 80.77         |
|    | 其中：股票             | 92,263,517.48  | 80.77         |
| 2  | 基金投资              | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 8,567,081.40   | 7.50          |
|    | 其中：债券             | 8,567,081.40   | 7.50          |
|    | 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          | 3,000,000.00   | 2.63          |
|    | 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      | 8,163,303.68   | 7.15          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,241,590.08   | 1.96          |
| 9  | 合计                | 114,235,492.64 | 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 62,567,362.14 元，占期末资产净值比例为 55.26%。

### 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              | 687,438.85    | 0.61          |
| C  | 制造业              | 14,266,457.33 | 12.60         |
| 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           | 446,000.00    | 0.39          |
| 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  | 5,432,502.56  | 4.80          |
| J  | 金融业              | 5,654,500.00  | 4.99          |
| K  | 房地产业             | 1,948,400.00  | 1.72          |
| 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    | —             | —             |



|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 622,000.00    | 0.55  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 638,856.60    | 0.56  |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 29,696,155.34 | 26.23 |

### 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    | 2,719,800.00  | 2.40         |
| B 消费者非必需品 | 10,507,983.44 | 9.28         |
| C 消费者常用品  | 4,930,000.00  | 4.35         |
| D 能源      | 22,144.90     | 0.02         |
| E 金融      | 13,374,994.56 | 11.81        |
| F 医疗保健    | 5,839,100.00  | 5.16         |
| G 工业      | 9,219,279.87  | 8.14         |
| H 信息技术    | 3,745,982.27  | 3.31         |
| I 电信服务    | 2,451,707.88  | 2.17         |
| J 公用事业    | 3,613,239.22  | 3.19         |
| K 房地产     | 6,143,130.00  | 5.43         |
| 合计        | 62,567,362.14 | 55.26        |

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前十名股票投资明细

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  | 601318 | 中国平安   | 26,000  | 2,303,860.00 | 2.03         |
| 1  | 02318  | 中国平安   | 15,000  | 1,237,650.00 | 1.09         |
| 2  | 03968  | 招商银行   | 70,779  | 2,424,888.54 | 2.14         |
| 2  | 600036 | 招商银行   | 21,000  | 755,580.00   | 0.67         |
| 3  | 00552  | 中国通信服务 | 480,000 | 2,558,400.00 | 2.26         |
| 4  | 03908  | 中金公司   | 180,000 | 2,494,800.00 | 2.20         |
| 5  | 00512  | 远大医药   | 600,000 | 2,388,000.00 | 2.11         |
| 6  | 00291  | 华润啤酒   | 70,000  | 2,284,800.00 | 2.02         |
| 7  | 01299  | 友邦保险   | 30,000  | 2,223,300.00 | 1.96         |
| 8  | 03323  | 中国建材   | 360,000 | 2,170,800.00 | 1.92         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

## 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  | 002384 | 东山精密   | 5,833,104.70 | 5.55           |
| 2  | 03323  | 中国建材   | 3,912,408.29 | 3.72           |
| 3  | 300578 | 会畅通讯   | 3,356,361.00 | 3.19           |
| 4  | 02333  | 长城汽车   | 3,122,599.51 | 2.97           |
| 5  | 00291  | 华润啤酒   | 3,062,466.17 | 2.91           |
| 6  | 00966  | 中国太平   | 3,061,893.14 | 2.91           |
| 7  | 300702 | 天宇股份   | 2,939,712.00 | 2.80           |
| 8  | 00763  | 中兴通讯   | 2,795,371.82 | 2.66           |
| 9  | 01800  | 中国交通建设 | 2,786,354.90 | 2.65           |
| 10 | 002597 | 金禾实业   | 2,669,642.00 | 2.54           |
| 11 | 300271 | 华宇软件   | 2,569,585.15 | 2.44           |
| 12 | 601628 | 中国人寿   | 2,509,354.00 | 2.39           |
| 13 | 01478  | 丘钛科技   | 2,460,551.38 | 2.34           |
| 14 | 00939  | 建设银行   | 2,371,034.40 | 2.26           |
| 15 | 002402 | 和而泰    | 2,327,942.00 | 2.21           |
| 16 | 600622 | 光大嘉宝   | 2,263,747.00 | 2.15           |
| 17 | 300400 | 劲拓股份   | 2,249,480.00 | 2.14           |
| 18 | 600029 | 南方航空   | 2,192,698.00 | 2.09           |
| 19 | 00998  | 中信银行   | 2,180,889.49 | 2.08           |
| 20 | 300579 | 数字认证   | 2,180,325.00 | 2.07           |
| 21 | 300559 | 佳发教育   | 2,169,458.00 | 2.06           |
| 22 | 300232 | 洲明科技   | 2,168,321.00 | 2.06           |
| 23 | 03888  | 金山软件   | 2,160,619.01 | 2.06           |
| 24 | 01918  | 融创中国   | 2,108,836.95 | 2.01           |

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（成交单价乘以成交数量）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  | 002384 | 东山精密         | 5,764,256.00 | 5.48 |
| 2  | 002773 | 康弘药业         | 4,112,420.50 | 3.91 |
| 3  | 600276 | 恒瑞医药         | 3,233,311.50 | 3.08 |
| 4  | 02328  | 中国财险         | 3,074,301.32 | 2.93 |
| 5  | 00966  | 中国太平         | 3,058,638.84 | 2.91 |
| 6  | 06088  | FIT HON TENG | 2,997,084.32 | 2.85 |
| 7  | 01336  | 新华保险         | 2,966,098.46 | 2.82 |
| 8  | 002402 | 和而泰          | 2,822,986.00 | 2.69 |
| 9  | 300036 | 超图软件         | 2,763,418.00 | 2.63 |
| 10 | 00763  | 中兴通讯         | 2,735,160.53 | 2.60 |
| 11 | 601628 | 中国人寿         | 2,726,951.00 | 2.59 |
| 12 | 002597 | 金禾实业         | 2,648,616.96 | 2.52 |
| 13 | 300702 | 天宇股份         | 2,642,044.19 | 2.51 |
| 14 | 300579 | 数字认证         | 2,540,521.50 | 2.42 |
| 15 | 300578 | 会畅通讯         | 2,460,110.00 | 2.34 |
| 16 | 600622 | 光大嘉宝         | 2,403,787.00 | 2.29 |
| 17 | 03968  | 招商银行         | 2,391,499.14 | 2.28 |
| 18 | 02186  | 绿叶制药         | 2,317,731.36 | 2.21 |
| 19 | 00753  | 中国国航         | 2,265,798.57 | 2.16 |
| 20 | 00939  | 建设银行         | 2,249,157.95 | 2.14 |
| 21 | 600029 | 南方航空         | 2,202,440.00 | 2.10 |
| 22 | 03323  | 中国建材         | 2,164,990.48 | 2.06 |
| 23 | 03888  | 金山软件         | 2,164,890.83 | 2.06 |
| 24 | 300400 | 劲拓股份         | 2,154,851.11 | 2.05 |

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（成交单价乘以成交数量）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 | 241,415,414.72 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 246,841,211.10 |

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（成交单价乘以成交数量）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      | 2,398,080.00 | 2.12         |
| 2  | 央行票据      | —            | —            |
| 3  | 金融债券      | 4,002,400.00 | 3.54         |
|    | 其中：政策性金融债 | 4,002,400.00 | 3.54         |
| 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） | 2,166,601.40 | 1.91         |
| 8  | 同业存单      | —            | —            |
| 9  | 其他        | —            | —            |
| 10 | 合计        | 8,567,081.40 | 7.57         |

**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  | 108603 | 国开 1804  | 40,000 | 4,002,400.00 | 3.54         |
| 2  | 019611 | 19 国债 01 | 24,000 | 2,398,080.00 | 2.12         |
| 3  | 110053 | 苏银转债     | 11,690 | 1,246,738.50 | 1.10         |
| 4  | 127010 | 平银转债     | 4,050  | 482,395.50   | 0.43         |
| 5  | 113021 | 中信转债     | 1,820  | 189,170.80   | 0.17         |

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

**7.8 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****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|----|----|----------|---------|-----------|------|
|----|----|----------|---------|-----------|------|

|                   |                     |    |             |           |            |
|-------------------|---------------------|----|-------------|-----------|------------|
| IH1907            | 上证 50 期货<br>1907 合约 | -1 | -873,900.00 | -8,940.00 | -          |
| 公允价值变动总额合计（元）     |                     |    |             |           | -8,940.00  |
| 股指期货投资本期收益（元）     |                     |    |             |           | -31,860.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |                     |    |             |           | -8,940.00  |

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据风险管理原则，本基金以套期保值为主要目的进行股指期货投资。通过对宏观经济和股票市场运行趋势的研究，结合自身股票组合的持仓特点，与现券资产进行匹配，通过套期保值策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑了股指期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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   | 429,703.33   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,140,618.14 |
| 3  | 应收股利    | 539,738.83   |
| 4  | 应收利息    | 129,740.95   |
| 5  | 应收申购款   | 1,788.83     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,241,590.08 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 128045 | 机电转债 | 156,956.80 | 0.14         |
| 2  | 128047 | 光电转债 | 91,339.80  | 0.08         |

#### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 2,252        | 45,164.13     | 50,947,723.39 | 50.09%     | 50,761,892.67 | 49.91%     |

### 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 | 198,911.30 | 0.1956%  |

### 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                      | 111, 670, 099. 48 |
| 本报告期基金总申购份额                       | 4, 817, 258. 52   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 14, 777, 741. 94  |
| 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                      | 101, 709, 616. 06 |

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

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、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

报告期内，本基金管理人、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 |    |
| 长江证券 | 2      | 219,498,442.98 | 45.08%       | 62,241.56 | 45.22%     | —  |
| 广发证券 | 2      | 140,998,593.88 | 28.96%       | 39,632.22 | 28.79%     | —  |
| 招商证券 | 2      | 68,061,027.22  | 13.98%       | 19,303.43 | 14.02%     | —  |
| 方正证券 | 2      | 43,696,879.10  | 8.97%        | 12,331.23 | 8.96%      | —  |
| 中金公司 | 2      | 14,660,020.06  | 3.01%        | 4,137.68  | 3.01%      | —  |
| 东方证券 | 2      | —              | —            | —         | —          | —  |
| 兴业证券 | 2      | —              | —            | —         | —          | —  |
| 中信证券 | 2      | —              | —            | —         | —          | —  |
| 申万宏源 | 2      | —              | —            | —         | —          | —  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 东兴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 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、本报告期内本基金租用券商交易单元变更情况：无。

### 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 |
| 长江证券 | 6,425,120.00 | 90.60%       | 263,000,000.00 | 58.84%         | —    | —            |
| 广发证券 | 666,884.00   | 9.40%        | 148,000,000.00 | 33.11%         | —    | —            |
| 招商证券 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |
| 方正证券 | —            | —            | 23,000,000.00  | 5.15%          | —    | —            |
| 中金公司 | —            | —            | 13,000,000.00  | 2.91%          | —    | —            |
| 东方证券 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |
| 兴业证券 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |
| 中信证券 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |
| 申万宏源 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |
| 东兴证券 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |
| 光大证券 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |
| 天风证券 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |
| 东吴证券 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |
| 国泰君安 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |
| 安信证券 | —            | —            | —              | —              | —    | —            |

## § 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              | 20190101 - 20190630     | 50,848,849.16 | 0.00 | 0.00 | 50,848,849.16 | 49.99% |
| 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 |
|---|

泰康资产管理有限责任公司

2019 年 8 月 24 日