

泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰康兴泰回报沪港深混合
基金主代码	004340
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 15 日
报告期末基金份额总额	510,740,544.69 份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过合理配置大类资产和精选投资标的，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将充分发挥管理人在大类资产配置上的投研究优势，综合运用定量分析和定型分析手段，全面评估证券市场当期的投资环境并对可以预见的未来时期内各大类资产的风险收益状况进行分析与预测。在此基础上，制定本基金在权益类资产与固收类资产上的战略配置比例，并定期或不定期地进行调整。 权益类投资方面，在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与权益类资产的投资，以增加基金收益。本基金在股票基本面研究的基础上，同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的国内 A 股及内地与香港股票市场交易互联互通机制下的港股投资标的股票，以此构建股票组合。本基金通过对国内 A 股市场和港股市场跨市场的投资，来达到分散投资风险、增强基金整体收益的目的。 固定收益类投资方面，本基金通过分析宏观经济运

	行情况、判断经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。另外，本基金在分析各类债券资产的信用风险、流动性风险及其收益率水平的基础上，通过比较或合理预期各类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整优先配置的资产类别和配置比例。	
业绩比较基准	20%*沪深 300 指数收益率+75%*中债新综合财富（总值）指数收益率+5%*金融机构人民币活期存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	泰康基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰康兴泰回报沪港深混合 A	泰康兴泰回报沪港深混合 C
下属分级基金的交易代码	004340	019110
报告期末下属分级基金的份额总额	510,740,544.69 份	-份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	报告期（2023 年 9 月 7 日-2023 年 9 月 30 日）
	泰康兴泰回报沪港深混合 A	泰康兴泰回报沪港深混合 C
1. 本期已实现收益	1,861,669.58	-
2. 本期利润	8,734,374.57	-
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0160	-
4. 期末基金资产净值	759,044,718.70	-
5. 期末基金份额净值	1.4862	1.4862

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金 C 类基金份额于 2023 年 9 月 7 日开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰康兴泰回报沪港深混合 A

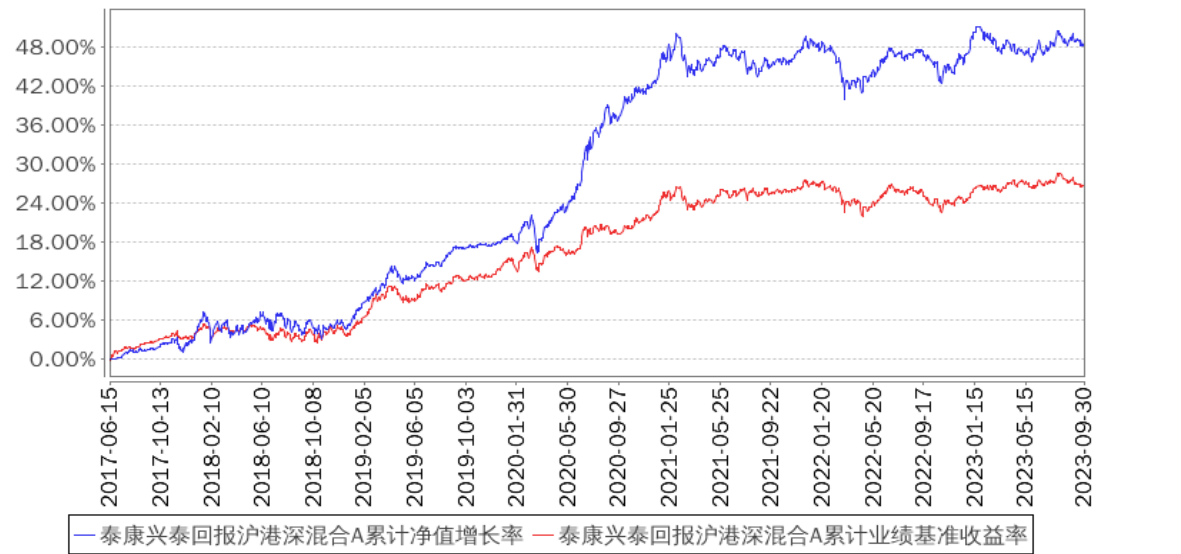
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.97%	0.27%	-0.26%	0.17%	1.23%	0.10%
过去六个月	-0.29%	0.26%	-0.03%	0.17%	-0.26%	0.09%
过去一年	1.57%	0.32%	2.06%	0.19%	-0.49%	0.13%
过去三年	8.01%	0.32%	6.18%	0.23%	1.83%	0.09%
过去五年	40.17%	0.33%	21.18%	0.24%	18.99%	0.09%
自基金合同生效起至今	48.62%	0.33%	26.68%	0.24%	21.94%	0.09%

泰康兴泰回报沪港深混合 C

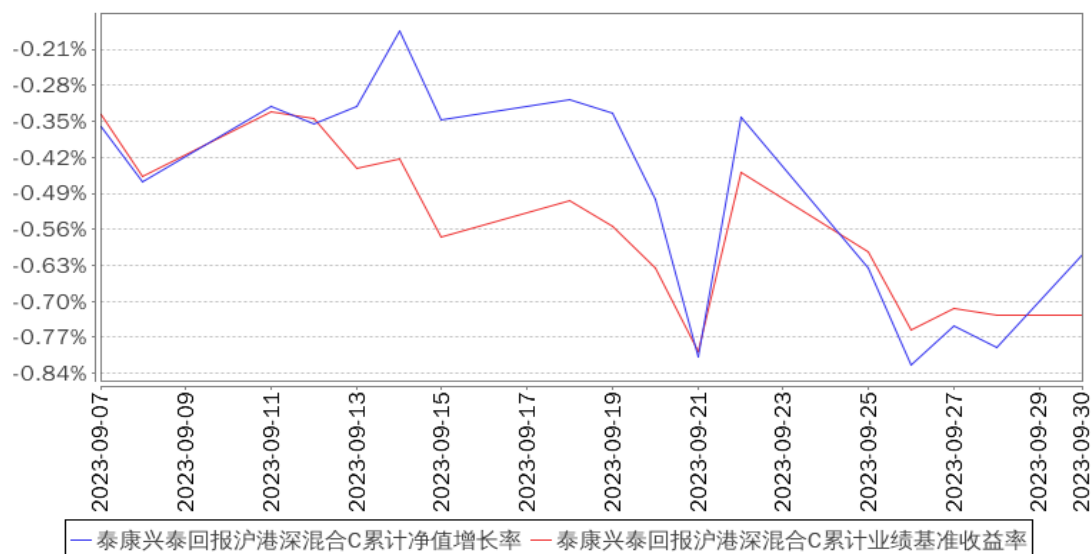
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	-0.61%	0.21%	-0.73%	0.15%	0.12%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰康兴泰回报沪港深混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰康兴泰回报沪港深混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势
对比图



注：1、本基金基金合同于 2017 年 06 月 15 日生效。

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋利娟	本基金基金经理、固定收益投资部负责人	2017 年 6 月 15 日	-	15 年	蒋利娟于 2008 年 7 月加入泰康资产，历任集中交易室交易员、固定收益部固定收益投资经理。2014 年 11 月加入泰康公募，担任固定收益基金经理、公募事业部固定收益投资负责人。现任泰康基金固定收益投资部负责人。2015 年 6 月 19 日至今担任泰康薪意保货币市场基金基金经理。2015 年 9 月 23 日至 2020 年 1 月 6 日担任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 8 日至 2016 年 12 月 27 日担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 2 月 3 日至今担任泰康稳健增利债券型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月 8 日至今担任泰康宏泰回报混合型证券投资

					资基金基金经理。2017 年 1 月 22 日至今担任泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 15 日至今担任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017 年 8 月 30 日至 2019 年 5 月 9 日担任泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 8 日至 2020 年 3 月 26 日担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。2018 年 5 月 30 日至今担任泰康颐年混合型证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 13 日至 2023 年 6 月 9 日担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 24 日至 2020 年 1 月 14 日担任泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 25 日至 2021 年 1 月 11 日担任泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 20 日至今担任泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 7 日至今担任泰康合润混合型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 2 日至今担任泰康浩泽混合型证券投资基金基金经理。
桂跃强	本基金基金经理、权益投资部负责人	2017 年 6 月 15 日	-	15 年	桂跃强于 2015 年 8 月加入泰康公募，担任公募事业部权益投资负责人。现任泰康基金权益投资部负责人。曾任石油化工科学研究院工程师，新华基金管理有限公司基金管理部副总监、基金经理等职务。2015 年 12 月 8 日至今担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月 8 日至今担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 28 日至 2020 年 9 月 22 日担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 15 日至今担任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 20 日至 2020 年 7 月 2 日担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 13 日至 2020 年 1 月 10 日担任泰康景泰回报混合型证券投资基金基金经理。2018 年 1 月 19 日至 2020 年 1 月 10 日担任泰康均衡优选混合型证券投资基金基金经理。2018 年 5 月 30 日至今担任泰康颐年

					混合型证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 13 日至 2020 年 7 月 24 日担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 23 日至今担任泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 7 日担任泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 14 日至今担任泰康蓝筹优势一年持有期股票型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 22 日至今担任泰康优势企业混合型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 14 日至今担任泰康鼎泰一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，三季度宏观经济总体处于偏弱运行的底部区域，但出现了一些企稳的迹象。尽管地产政策有所放松，但地产部门表现仍然疲弱。与此同时，出口在极低增速的背景下出现了

一定反弹，PPI、工业名义库存、企业利润也从低位出现了小幅改善，PMI 在 9 月份也回升到 50 上方。

债券市场方面，利率运行节奏基本上与基本面节奏一致。7 月份由于经济数据仍在下滑通道，利率继续下行；8 月开始稳增长政策不断出台，经济低位企稳的迹象陆续出现，利率有所反弹。此外，流动性环境也在 9 月份有所变化，资金利率回到政策利率上方运行，给债券特别是短端品种带来制约。

进入三季度以来市场环境发生了一些积极的变化：中央和地方出台了一系列政策，无论是针对资本市场的印花税减免还是针对实体经济的房地产政策等；国内短期的月度经济数据也出现了环比改善，企稳补库的迹象。但海外方面美债利率持续攀升，全球投资者在重新定价一个更高的基础利率环境。中美关系层面虽然双方也在进行一些切实的努力沟通改善，但中长期的分歧短期看来难以消弭，叠加前期对于中国经济的悲观预期，总体来看三季度外资持续流出，无论对 A 股还是港股都形成较大的压力。

投资策略上，在利率债方面，根据市场形势积极适度调节仓位和久期；在信用债方面，严格防范信用风险，密切跟踪中微观行业和个体的变化，对个券进行深入研究，积极规避尾部风险。

权益投资方面，在本期，基金在仓位上略有调整。在持仓品种上，我们继续向有竞争优势、业绩较为确定、估值有一定合理性的品种集中。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 份额净值为 1.4862 元，本报告期基金 A 份额净值增长率为 0.97%，同期业绩比较基准增长率为-0.26%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.4862 元，本报告期基金 C 份额净值增长率为-0.61%，同期业绩比较基准增长率为-0.73%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	157,334,872.25	14.96
	其中：股票	157,334,872.25	14.96
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	887,646,377.32	84.38

	其中：债券	887,646,377.32	84.38
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	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	4,597,908.16	0.44
8	其他资产	2,335,104.51	0.22
9	合计	1,051,914,262.24	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 66,374,168.69 元，占期末资产净值比例为 8.74%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	90,658,175.66	11.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,563.97	0.00
E	建筑业	11,369.83	0.00
F	批发和零售业	89,799.53	0.01
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	127,897.60	0.02
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	14,669.76	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	25,227.21	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	90,960,703.56	11.98

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
------	-----------	--------------

A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	11,913,700.25	1.57
C 消费者常用品	-	-
D 能源	25,244,730.00	3.33
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	29,215,738.44	3.85
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	66,374,168.69	8.74

注：以上行业分类标准来源于财汇。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	103,978	29,215,738.44	3.85
2	01088	中国神华	1,083,000	25,244,730.00	3.33
3	600519	贵州茅台	12,700	22,841,585.00	3.01
4	000333	美的集团	289,500	16,061,460.00	2.12
5	600809	山西汾酒	59,100	14,154,450.00	1.86
6	000858	五粮液	86,949	13,572,738.90	1.79
7	01797	东方甄选	275,975	9,358,312.25	1.23
8	002304	洋河股份	43,958	5,688,165.20	0.75
9	002311	海大集团	116,576	5,275,064.00	0.69
10	600031	三一重工	236,637	3,760,161.93	0.50

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	292,202,303.29	38.50
	其中：政策性金融债	78,216,135.62	10.30
4	企业债券	82,291,827.89	10.84
5	企业短期融资券	88,193,888.42	11.62
6	中期票据	357,980,823.69	47.16
7	可转债（可交换债）	66,977,534.03	8.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	887,646,377.32	116.94

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	2228039	22 建设银行二级 01	500,000	51,004,672.13	6.72
2	2228024	22 工商银行二级 03	400,000	41,140,218.58	5.42
3	190401	19 农发 01	300,000	32,318,465.75	4.26
4	102100022	21 六安城投 MTN001	300,000	31,091,330.96	4.10
5	092280033	22 宁波银行二级 资本债 01	300,000	30,093,226.23	3.96

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

宁波银行股份有限公司因违规开展异地互联网贷款业务等行为在本报告编制前一年内受到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局的公开处罚。

中国建设银行股份有限公司因公司治理和内部控制制度与监管规定不符、个人经营贷款挪用至房地产市场、理财老产品规模在部分时点出现反弹等行为在本报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外，其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	49,818.35
2	应收证券清算款	2,283,380.77
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,905.39
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	2,335,104.51

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110085	通 22 转债	3,935,451.42	0.52
2	113048	晶科转债	3,282,292.31	0.43
3	113060	浙 22 转债	3,132,142.46	0.41
4	113545	金能转债	2,891,934.25	0.38
5	123162	东杰转债	2,786,230.23	0.37
6	127027	能化转债	2,371,609.45	0.31
7	110075	南航转债	2,201,436.70	0.29
8	113051	节能转债	2,146,978.10	0.28
9	127045	牧原转债	1,900,309.03	0.25

10	113044	大秦转债	1,704,843.46	0.22
11	113657	再 22 转债	1,676,824.77	0.22
12	113045	环旭转债	1,646,057.31	0.22
13	123107	温氏转债	1,465,420.70	0.19
14	127040	国泰转债	1,410,511.42	0.19
15	127075	百川转 2	1,396,736.74	0.18
16	110045	海澜转债	1,294,670.89	0.17
17	123119	康泰转 2	1,194,500.12	0.16
18	110092	三房转债	1,178,813.75	0.16
19	128048	张行转债	1,099,372.42	0.14
20	113632	鹤 21 转债	1,026,592.26	0.14
21	113050	南银转债	990,463.74	0.13
22	113637	华翔转债	956,521.78	0.13
23	113619	世运转债	952,504.12	0.13
24	111012	福新转债	911,570.23	0.12
25	128141	旺能转债	840,553.71	0.11
26	118022	锂科转债	795,987.73	0.10
27	128119	龙大转债	758,619.11	0.10
28	113056	重银转债	720,429.80	0.09
29	110087	天业转债	702,358.71	0.09
30	123169	正海转债	701,337.91	0.09
31	127043	川恒转债	682,208.51	0.09
32	123114	三角转债	670,351.73	0.09
33	127050	麒麟转债	652,761.14	0.09
34	113653	永 22 转债	614,209.78	0.08
35	111000	起帆转债	569,894.38	0.08
36	110074	精达转债	535,035.93	0.07
37	113602	景 20 转债	466,326.24	0.06
38	127069	小熊转债	460,549.56	0.06
39	113062	常银转债	457,868.67	0.06
40	127030	盛虹转债	444,549.15	0.06
41	127032	苏行转债	391,563.17	0.05
42	113037	紫银转债	389,550.68	0.05
43	113021	中信转债	372,767.65	0.05
44	110088	淮 22 转债	368,502.72	0.05
45	110061	川投转债	364,557.97	0.05
46	127078	优彩转债	352,023.45	0.05
47	113640	苏利转债	348,249.78	0.05
48	113030	东风转债	308,242.50	0.04
49	113631	皖天转债	304,548.98	0.04
50	132018	G 三峡 EB1	294,603.56	0.04
51	110084	贵燃转债	290,012.98	0.04

52	128137	洁美转债	288,740.05	0.04
53	113057	中银转债	287,019.52	0.04
54	127020	中金转债	275,016.00	0.04
55	110067	华安转债	243,486.48	0.03
56	123158	宙邦转债	237,029.42	0.03
57	113549	白电转债	234,857.52	0.03
58	113504	艾华转债	227,364.66	0.03
59	123172	漱玉转债	219,241.23	0.03
60	127060	湘佳转债	202,654.60	0.03
61	123067	斯莱转债	194,024.50	0.03
62	113043	财通转债	194,012.47	0.03
63	110073	国投转债	192,727.70	0.03
64	123163	金沃转债	181,943.63	0.02
65	113588	润达转债	174,610.62	0.02
66	111010	立昂转债	168,897.55	0.02
67	127006	敖东转债	163,807.12	0.02
68	128132	交建转债	162,490.75	0.02
69	118019	金盘转债	155,547.33	0.02
70	113527	维格转债	150,127.07	0.02
71	113055	成银转债	149,551.04	0.02
72	110062	烽火转债	148,243.40	0.02
73	128123	国光转债	144,536.38	0.02
74	111004	明新转债	127,217.62	0.02
75	113662	豪能转债	126,014.53	0.02
76	113563	柳药转债	125,228.22	0.02
77	113629	泉峰转债	121,078.27	0.02
78	128121	宏川转债	109,880.28	0.01
79	111005	富春转债	99,799.67	0.01
80	113532	海环转债	97,527.32	0.01
81	111008	沿浦转债	97,471.46	0.01
82	113594	淳中转债	95,328.04	0.01
83	111011	冠盛转债	81,514.92	0.01
84	123090	三诺转债	71,779.48	0.01
85	110090	爱迪转债	71,564.38	0.01
86	123078	飞凯转债	68,092.53	0.01
87	118004	博瑞转债	59,557.53	0.01
88	113660	寿 22 转债	56,715.40	0.01
89	110060	天路转债	55,264.49	0.01
90	123174	精锻转债	54,108.57	0.01
91	118003	华兴转债	53,066.14	0.01
92	110048	福能转债	51,037.70	0.01
93	127061	美锦转债	48,601.81	0.01

94	111007	永和转债	48,185.70	0.01
95	113042	上银转债	43,627.45	0.01
96	127072	博实转债	27,885.97	0.00
97	113621	彤程转债	27,808.71	0.00
98	123164	法本转债	27,400.49	0.00
99	123150	九强转债	27,000.38	0.00
100	128083	新北转债	26,270.66	0.00
101	118017	深科转债	25,767.84	0.00
102	123177	测绘转债	21,413.01	0.00
103	118033	华特转债	18,785.63	0.00
104	127065	瑞鹄转债	11,225.14	0.00
105	123176	精测转 2	8,150.17	0.00
106	127079	华亚转债	6,576.17	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康兴泰回报沪港深混合 A	泰康兴泰回报沪港深混合 C
报告期期初基金份额总额	580,380,329.78	—
报告期期间基金总申购份额	1,147,001.91	—
减:报告期期间基金总赎回份额	70,786,787.00	—
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
报告期期末基金份额总额	510,740,544.69	—

注：1、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。

2 泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金 C 类基金份额于 2023 年 9 月 7 日开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金注册的文件；
- （二）《泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金合同》；
- （三）《泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金招募说明书》；
- （四）《泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金托管协议》；
- （五）《泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金产品资料概要》。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康基金管理有限公司

2023 年 10 月 24 日