

泰康恒泰回报灵活配置混合型
证券投资基金
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 日

§1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2023 年 10 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰康恒泰回报混合
基金主代码	002934
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 13 日
报告期末基金份额总额	180,418,016.45 份
投资目标	本基金在合理控制风险的基础上，通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动式组合管理获得超过业绩比较基准的收益。 大类资产配置方面，本基金综合考虑宏观、政策、市场供求、投资价值比较、风险水平等因素，在股票与债券等资产类别之间进行动态资产配置。 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。

	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、估值合理的上市公司股票进行投资。	
业绩比较基准	中债新综合财富（总值）指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*20%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	泰康基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C
下属分级基金的交易代码	002934	002935
报告期末下属分级基金的份额总额	12,766,287.40 份	167,651,729.05 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 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C
1. 本期已实现收益	114,355.66	1,421,252.92
2. 本期利润	93,725.51	972,439.30
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0071	0.0047
4. 期末基金资产净值	12,859,474.09	175,862,892.61
5. 期末基金份额净值	1.0073	1.0490

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰康恒泰回报混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

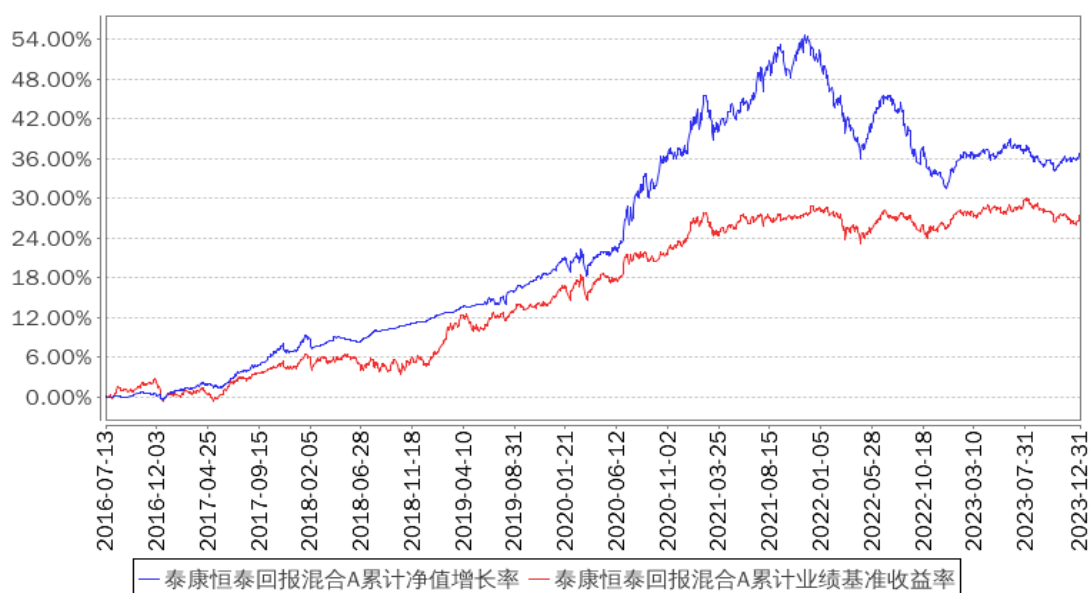
过去三个月	0.74%	0.14%	-0.37%	0.16%	1.11%	-0.02%
过去六个月	-0.84%	0.17%	-0.63%	0.17%	-0.21%	0.00%
过去一年	3.06%	0.20%	1.25%	0.17%	1.81%	0.03%
过去三年	-1.84%	0.38%	2.11%	0.22%	-3.95%	0.16%
过去五年	22.61%	0.36%	21.39%	0.24%	1.22%	0.12%
自基金合同 生效起至今	36.77%	0.30%	27.50%	0.23%	9.27%	0.07%

泰康恒泰回报混合 C

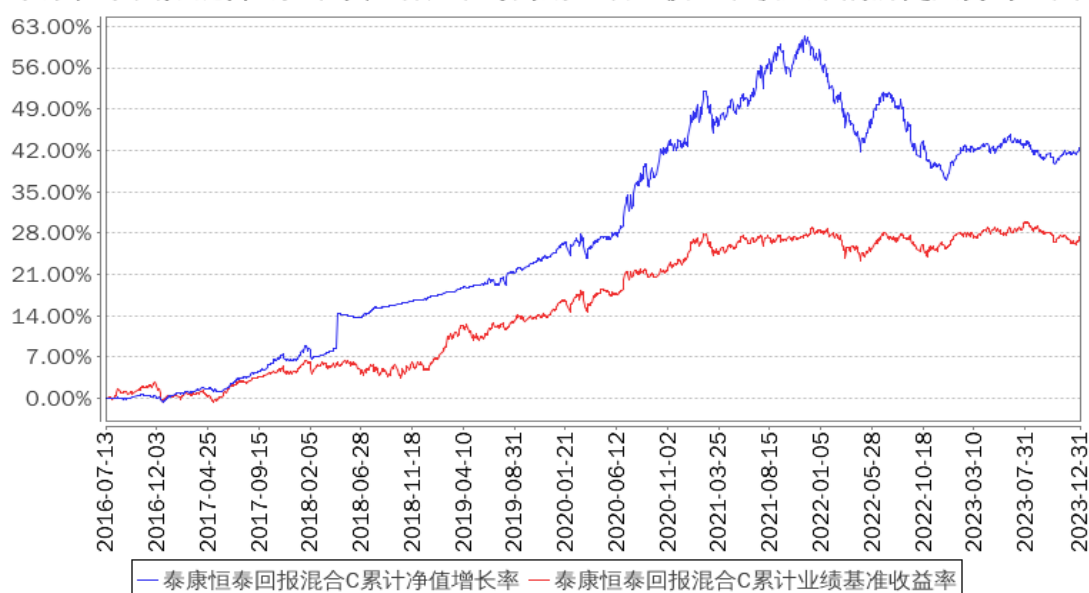
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	0.72%	0.14%	-0.37%	0.16%	1.09%	-0.02%
过去六个月	-0.88%	0.17%	-0.63%	0.17%	-0.25%	0.00%
过去一年	2.98%	0.20%	1.25%	0.17%	1.73%	0.03%
过去三年	-2.11%	0.38%	2.11%	0.22%	-4.22%	0.16%
过去五年	21.78%	0.36%	21.39%	0.24%	0.39%	0.12%
自基金合同 生效起至今	42.44%	0.32%	27.50%	0.23%	14.94%	0.09%

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

泰康恒泰回报混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰康恒泰回报混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 07 月 13 日生效。

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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
任慧娟	本基金基金经理	2016 年 7 月 13 日	—	16 年	任慧娟于 2015 年 8 月加入泰康公募，现任泰康基金固定收益基金经理。曾任阳光财产保险公司资产管理中心固定收益投资部高级投资经理。2015 年 12 月 9 日至 2022 年 10 月 26 日担任泰康薪意保货币市场基金基金经理。2016 年 5 月 9 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 7 月 13 日至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 24 日至今担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 21 日至 2019 年 5 月 8 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 9 月 8 日至今担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康申润一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2022 年 8 月 1 日至今担任泰康丰盛纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 20 日至 2024 年 1 月 12 日担任泰康安泓纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 28 日至今担任泰康丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
金宏伟	本基金基金经理	2020 年 7 月 2 日	—	11 年	金宏伟于 2016 年 12 月加入泰康公募，现任泰康基金股票基金经理。曾任中钢集团工程总包项目经理、工程师、国际商务师，新华基金管理有限公司行业研究员、中上游行业组长、中游及 TMT 行业组长、研究部总监助理、专户投资部投资经理等职务。2017 年 8 月 28 日至 2023 年 2 月 7 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。2017 年 8 月 28 日至 2019 年 5 月 9 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。2020 年 7 月 2 日至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 24 日至今担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 10 日至今担任泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 7 日至 2024 年 1 月 5 日担任泰康裕泰债券型证券投资基金基金经理。2022 年 6

					月 1 日至今担任泰康招享混合型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 29 日至今担任泰康景气行业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，四季度延续了偏弱运行的态势，复苏的力度不足。终端需求的表现不佳，零售在三季度的出行热之后脉冲力度下降，房地产尽管政策频出但持续处于下滑通道。最大的边际变化来自于国债增发和一揽子化债，财政政策有所发力，通过中央政府加杠杆对冲地方政府化债的收缩压力。

债券市场方面，利率走出了倒 V 型，12 月收益率出现了明显的回落，10Y 国债收益率年末回落到 2.55-2.6%区间。制约债市在 10-11 月表现的一些因素，在 12 月有所逆转，如财政加码预期，被明年的财政政策力度适度的展望所中和；资金面的收敛也在 12 月跨年中有所缓解；存款利率下调也引发了一定的货币宽松预期。

固收投资方面，本基金在报告期内以获取持有期收益为主要目标，在控制组合久期水平的基

基础上，根据市场形势调整利率债、信用债及商业银行金融债的配置比例，维持较高的杠杆水平。信用债方面，精挑细选优质主体，严防信用尾部风险。

权益市场方面，进入四季度，经济增长趋弱，逆周期调节持续，信用政策持续宽松，货币整体合理充裕，财政政策持续，房地产出口消费趋弱，国际环境变化较多，中美是有管控的竞争，市场整体偏弱。从大盘和板块上来看，四季度上证综指下跌 4.36%，沪深 300 下跌 7.00%，创业板指下跌 5.62%。板块间波动较大，其中，煤炭、农林牧渔和电子等有上涨，美容护理、房地产、建筑材料等下跌较多。

权益投资方面，在本期，继续以权益底仓+选择性参与新股申购策略运作，基金在仓位上相机抉择，整体保持低位。在行业配置上，以公用事业、通信、计算机、电网设备和生物医药等为主，适当配置其他优质个股。站在当下时点，科技发展、政策支持、行业景气和低估值高分红是市场重点关注的方向，本基金投资坚持“自下而上为主、自上而下为辅”的策略，寻找估值、增速和公司及行业前景相匹配的个股进行配置。展望 2024 年一季度，逆周期调节持续但不激进，货币相对宽松，经济继续低速增长，AI 为代表的科技影响继续，海外市场和国际关系不确定性继续，叠加股市往往有的“春季躁动”，综合起来，市场震荡上行概率较大，同时也体现为结构上的变化，仓位上相机而动，操作上继续以权益底仓+选择性参与新股申购的策略运作，行业上重点关注生物医药、TMT、高端装备、公用事业等行业和部分低估值高分红个股，相对均衡策略。

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 1.0073 元,本报告期基金 A 份额净值增长率为 0.74%;截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.0490 元,本报告期基金 C 份额净值增长率为 0.72%;同期业绩比较基准增长率为-0.37%。

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	23,074,295.26	8.59
	其中：股票	23,074,295.26	8.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	239,874,181.64	89.31

	其中：债券	239,874,181.64	89.31
	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	947,169.04	0.35
8	其他资产	4,689,654.76	1.75
9	合计	268,585,300.70	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	14,674,012.51	7.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,259,706.00	0.67
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
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	6,580,416.75	3.49
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	—	—
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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	560,160.00	0.30
S	综合	—	—
	合计	23,074,295.26	12.23

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002270	华明装备	176,000	2,485,120.00	1.32
2	601728	中国电信	366,300	1,981,683.00	1.05
3	002179	中航光电	49,900	1,946,100.00	1.03
4	600285	羚锐制药	89,600	1,533,056.00	0.81
5	002063	远光软件	220,700	1,363,926.00	0.72
6	301171	易点天下	67,500	1,334,475.00	0.71
7	600886	国投电力	95,400	1,257,372.00	0.67
8	002465	海格通信	91,000	1,169,350.00	0.62
9	002583	海能达	189,200	1,125,740.00	0.60
10	000400	许继电气	27,800	610,488.00	0.32

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	135,593,653.37	71.85
	其中：政策性金融债	37,994,314.48	20.13
4	企业债券	30,878,886.03	16.36
5	企业短期融资券	11,139,484.26	5.90
6	中期票据	40,974,829.51	21.71
7	可转债（可交换债）	11,389,017.59	6.03
8	同业存单	9,898,310.88	5.24
9	其他	—	—
10	合计	239,874,181.64	127.10

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	200210	20 国开 10	200,000	20,848,639.34	11.05
2	220322	22 进出 22	170,000	17,145,675.14	9.09
3	148253	23 广发 Y2	100,000	10,536,745.21	5.58
4	2228017	22 邮储银行二级 01	100,000	10,488,357.38	5.56
5	2028034	20 浦发银行二级 03	100,000	10,376,933.33	5.50

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

广发银行股份有限公司因小微企业划型不准确、违规发放房地产贷款等原因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的公开处罚。

广发证券股份有限公司因未依法履行其他职责在本报告编制前一年内受到中国证券监督管理委员会的公开处罚、公开批评和责令改正。

中国银行股份有限公司因违反规定从事未经批准的业务活动等行为在本报告编制前一年内受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的行政处罚，因小微企业贷款风险分类不准确等原因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的行政处罚。

中国邮政储蓄银行股份有限公司因违反反假货币业务管理规定等行为在本报告编制前一年内受到中国人民银行的公开处罚和公开批评。

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	92,985.84
2	应收证券清算款	4,594,171.80
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,497.12
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	4,689,654.76

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	113043	财通转债	554,046.75	0.29
2	110067	华安转债	477,612.49	0.25
3	110073	国投转债	417,203.77	0.22
4	110093	神马转债	369,272.20	0.20
5	128109	楚江转债	360,408.73	0.19
6	128042	凯中转债	359,758.28	0.19
7	127059	永东转 2	356,080.54	0.19
8	113649	丰山转债	343,873.10	0.18
9	113060	浙 22 转债	332,782.54	0.18
10	110081	闻泰转债	318,949.33	0.17
11	127068	顺博转债	311,103.79	0.16
12	113618	美诺转债	264,506.24	0.14
13	110064	建工转债	250,779.01	0.13
14	123171	共同转债	173,137.07	0.09
15	127007	湖广转债	160,845.62	0.09
16	110088	淮 22 转债	146,750.96	0.08
17	111010	立昂转债	137,491.56	0.07
18	132026	G 三峡 EB2	114,306.90	0.06

19	123160	泰福转债	110,400.72	0.06
20	127018	本钢转债	107,831.02	0.06
21	113050	南银转债	106,016.85	0.06
22	128138	侨银转债	105,837.53	0.06
23	123049	维尔转债	104,967.59	0.06
24	123106	正丹转债	103,590.25	0.05
25	123153	英力转债	103,223.96	0.05
26	110086	精工转债	103,008.36	0.05
27	113056	重银转债	102,298.99	0.05
28	127022	恒逸转债	101,602.52	0.05
29	123119	康泰转 2	101,540.75	0.05
30	113569	科达转债	101,267.75	0.05
31	113065	齐鲁转债	100,338.93	0.05
32	118023	广大转债	99,177.67	0.05
33	113616	韦尔转债	97,139.71	0.05
34	113640	苏利转债	96,920.56	0.05
35	123159	崧盛转债	96,856.37	0.05
36	123151	康医转债	95,702.00	0.05
37	123124	晶瑞转 2	95,352.86	0.05
38	127077	华宏转债	94,939.22	0.05
39	123172	漱玉转债	94,400.95	0.05
40	123193	海能转债	93,376.86	0.05
41	123190	道氏转 02	92,967.19	0.05
42	123141	宏丰转债	92,360.16	0.05
43	128124	科华转债	90,920.64	0.05
44	113593	沪工转债	88,698.83	0.05
45	123132	回盛转债	86,955.16	0.05
46	123162	东杰转债	84,834.49	0.04
47	111005	富春转债	77,011.46	0.04
48	123076	强力转债	64,255.17	0.03
49	111000	起帆转债	63,370.85	0.03
50	123048	应急转债	59,992.26	0.03
51	128118	瀛通转债	57,755.99	0.03
52	123149	通裕转债	57,401.85	0.03
53	113647	禾丰转债	57,239.18	0.03
54	127026	超声转债	56,404.45	0.03
55	113055	成银转债	56,133.26	0.03
56	123064	万孚转债	55,460.55	0.03
57	113504	艾华转债	55,198.49	0.03
58	127016	鲁泰转债	54,928.90	0.03
59	113644	艾迪转债	54,858.01	0.03
60	113048	晶科转债	54,587.26	0.03

61	110085	通 22 转债	54,211.33	0.03
62	127034	绿茵转债	53,494.59	0.03
63	113584	家悦转债	53,490.21	0.03
64	113668	鹿山转债	53,267.74	0.03
65	113046	金田转债	53,194.86	0.03
66	113059	福莱转债	53,138.84	0.03
67	113661	福 22 转债	52,658.15	0.03
68	127075	百川转 2	52,650.55	0.03
69	123082	北陆转债	52,640.38	0.03
70	113054	绿动转债	52,200.89	0.03
71	127033	中装转 2	51,939.93	0.03
72	118034	晶能转债	51,476.11	0.03
73	113053	隆 22 转债	51,438.25	0.03
74	118031	天 23 转债	50,870.86	0.03
75	123063	大禹转债	48,799.76	0.03
76	123184	天阳转债	48,182.41	0.03
77	113600	新星转债	48,137.42	0.03
78	113629	泉峰转债	44,715.56	0.02
79	127086	恒邦转债	44,518.02	0.02
80	123144	裕兴转债	43,532.16	0.02
81	123113	仙乐转债	43,241.32	0.02
82	113665	汇通转债	43,015.45	0.02
83	128105	长集转债	42,803.12	0.02
84	118032	建龙转债	42,702.64	0.02
85	111009	盛泰转债	42,664.11	0.02
86	113542	好客转债	42,363.77	0.02
87	113643	风语转债	41,747.98	0.02
88	123128	首华转债	41,121.48	0.02
89	110087	天业转债	40,943.33	0.02
90	123114	三角转债	39,463.80	0.02
91	127071	天箭转债	38,574.97	0.02
92	127079	华亚转债	34,913.49	0.02
93	113045	环旭转债	34,088.54	0.02
94	113573	纵横转债	33,919.71	0.02
95	113653	永 22 转债	32,641.94	0.02
96	113066	平煤转债	29,812.04	0.02
97	123157	科蓝转债	26,459.73	0.01
98	128083	新北转债	24,186.79	0.01
99	118035	国力转债	19,760.56	0.01
100	113602	景 20 转债	14,788.49	0.01
101	128074	游族转债	14,341.74	0.01
102	118003	华兴转债	9,519.46	0.01

103	123109	昌红转债	9,237.02	0.00
104	113654	永 02 转债	8,361.61	0.00
105	127072	博实转债	3,903.02	0.00
106	113524	奇精转债	3,760.47	0.00
107	128144	利民转债	3,290.60	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	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C
报告期期初基金份额总额	13,650,715.13	261,022,260.87
报告期期间基金总申购份额	81,017.26	177,625.19
减：报告期期间基金总赎回份额	965,444.99	93,548,157.01
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	12,766,287.40	167,651,729.05

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）

别		20%的时间区 间					
机 构	1	20231001 – 20231231	59,787,537.02	–	–	59,787,537.02	33.14
	2	20231001 – 20231112	87,440,282.97	–	–	87,440,282.97	–
个 人	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
当本基金出现单一持有人持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- （二）《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- （三）《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- （四）《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- （五）《泰康恒泰回报灵活配置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
2024 年 1 月 19 日