

# 泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券 投资基金 2018 年半年度报告摘要

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 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。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。

基金托管人招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)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。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 泰康金泰 3 月定开混合    |
| 基金主代码      | 003813          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2017 年 1 月 22 日 |
| 基金管理人      | 泰康资产管理有限责任公司    |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额 | 76,654,707.13 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金利用定期开放的运作特性，通过积极主动的投资管理，在合理控制风险的基础上，追求超越业绩比较基准的收益水平。   |
| 投资策略   | <p>本基金将充分发挥基金管理人在大类资产配置上的投资研究优势，综合运用定量分析和定性分析手段，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定收益类资产上的战略配置比例，并定期或不定期地进行调整。</p> <p>股票投资方面，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，将影响上市公司基本面和股价的增长类因素、估值类因素、盈利类因素、财务风险等因素进行综合分析，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，以此构建股票组合。</p> <p>债券投资方面，本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期和期限结构配置。信用债投资方面，本基金将利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估，重点分析发债主体的行业发展前景、市场地位、公司治理、财务质量、融资目的等要素，分析违约风险以及合理信用利差水平，识别投资价值。</p> |
| 业绩比较基准 | 15%*沪深 300 指数收益率+85%*中债新综合财富（总值）指数收益率   |
| 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。  |

**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               | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 陈玮光                        | 张燕                     |
|         | 联系电话 | 010-58753683               | 0755-83199084          |
|         | 电子邮箱 | chenwg06@taikangamc.com.cn | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4001895522                 | 95555                  |
| 传真      |      | 010-57818785               | 0755-83195201          |

**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(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,641,452.20                |
| 本期利润          | 4,303,551.60                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0353                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.47%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日)            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0538                      |
| 期末基金资产净值      | 81,575,943.21               |
| 期末基金份额净值      | 1.0642                      |

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。

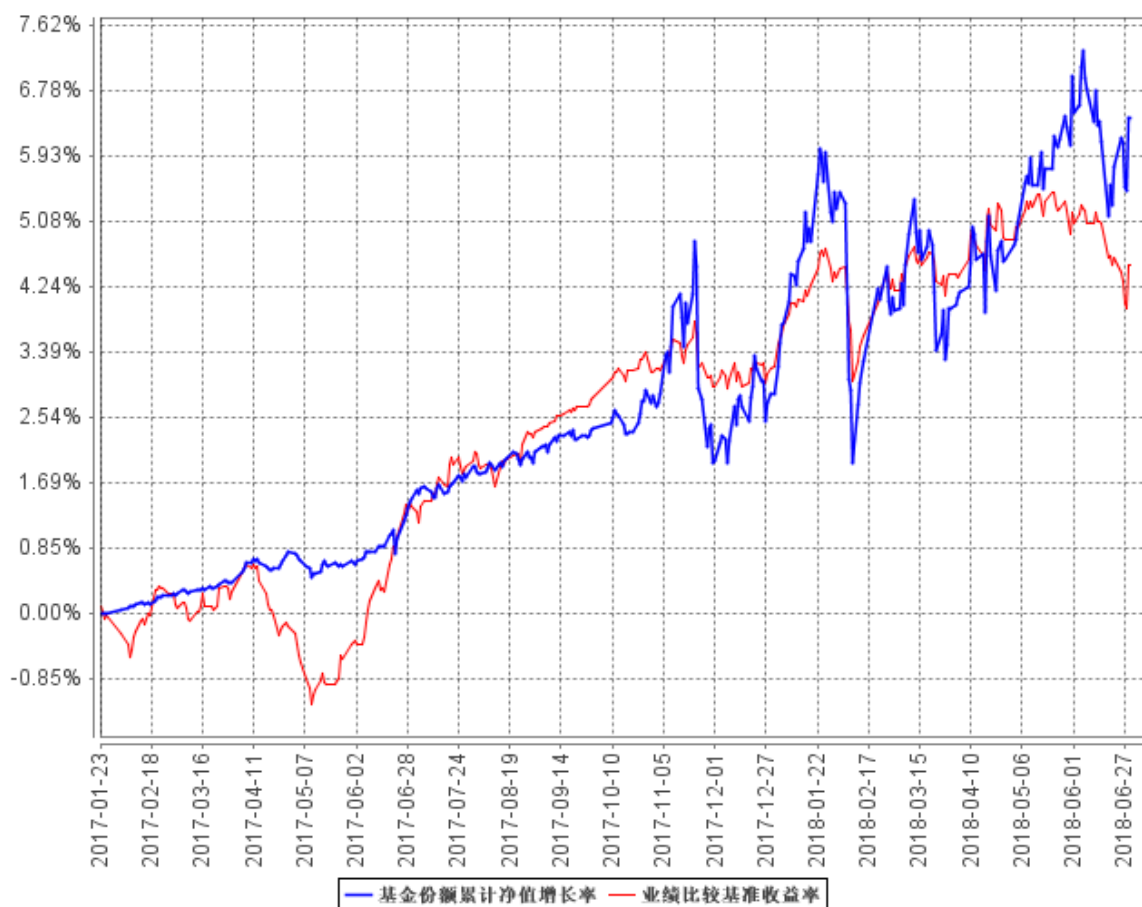
#### 3.2 基金净值表现

##### 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      | -0.51%   | 0.43%       | -0.65%     | 0.19%         | 0.14% | 0.24% |
| 过去三个月      | 2.37%    | 0.37%       | 0.12%      | 0.18%         | 2.25% | 0.19% |
| 过去六个月      | 3.47%    | 0.40%       | 1.27%      | 0.18%         | 2.20% | 0.22% |
| 过去一年       | 4.87%    | 0.32%       | 3.08%      | 0.15%         | 1.79% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.42%    | 0.27%       | 4.51%      | 0.14%         | 1.91% | 0.13% |

### 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 2017 年 1 月 22 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 |        |   |
| 蒋利娟 | 本基金基金经理 | 2017 年 1 月 22 日 | -    | 10     | 蒋利娟于 2008 年 7 月加入泰康资产，历任集中交易室交易员，固定收益投资部流动性投资经理、固 |

|    |         |                  |   |   |   |
|----|---------|------------------|---|---|---|
|    |         |                  |   |   | <p>定收益投资经理，固定收益投资中心固定收益投资经理。现任公募事业部固定收益投资执行总监。</p> <p>2015 年 6 月 19 日至今担任泰康薪金保货币市场基金基金经理。2015 年 9 月 23 日至今担任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2015 年 12 月 8 日至 2016 年 12 月 27 日任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2016 年 2 月 3 日至今任泰康稳健增利债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>2016 年 6 月 8 日至今任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2017 年 1 月 22 日至今任泰康金泰回报 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 日至今任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017 年 8 月 30 日至今担任泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 8 日至今担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。</p> <p>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。</p> <p>2018 年 6 月 13 日至今担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。</p> |
| 陈怡 | 本基金基金经理 | 2017 年 10 月 13 日 | - | 6 | <p>陈怡于 2016 年 5 月加入泰康资产，历任万家基金管理有限公司研究部研究员，平安养老保险股份有限公司权益投资部研究员、</p>  |



|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>行业投资经理。2017 年 4 月 19 日至今任泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2017 年 10 月 13 日至今任泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 9 日至今任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 28 日至今任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2018 年 1 月 19 日至今任泰康均衡优选混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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

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。

债券市场方面，1 月初受金融监管政策影响、利率有所上行，此后呈现震荡下行的走势。一月末以来，银行间资金面保持相对宽松，短端利率明显下行；叠加社融增速下行、贸易战等因素引发市场对基本面的担忧，带动长端利率下行。4 月 17 日，央行宣布降准置换 MLF，带动利率快速下行；但随后随着资金面紧张，叠加油价快速上行，美债突破 3%，国内利率有所回调。5 月下半月以来，国内信用风险频发又带来市场对紧信用的担忧，同时央行的货币政策明显调整，先是不跟随美联储加息、然后又进行降准，利率震荡下行。上半年来看，10Y 国债下行 41bp，10Y 国开下行 57bp。

权益市场方面，受中美贸易摩擦，国内信用紧缩和市场避险情绪升温等因素影响，上半年权益市场整体下行明显，上证综指下跌 13.90%，沪深 300 下跌 12.90%，中小板指下跌 14.26%，创业板指下跌 8.33%。从行业来看，食品饮料、医药生物、计算机及家用电器板块表现相对较好，传媒、电力设备、建材机械等行业表现不佳。

固收投资方面，基金先是维持了中性偏低的久期，后跟随市场节奏增加了利率债的配置，适度拉长了组合久期。基金主要配置信用风险可控的中高等级信用债、CD 等，以获取相对稳健的持有期收益；此外基金精选优质可转债、可交换债，以增厚组合收益。

权益投资方面，基金开局延续了低估值蓝筹的配置，自 3 月份起，在中美贸易摩擦和去杠杆的双重压力下，中国经济数据持续低于预期，配置转为谨慎，逐渐向防御和真成长倾斜，主要配置食品饮料、医药生物、纺织服装等板块，维持相对中性的仓位，等待获取绝对收益更好的时机。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康金泰回报 3 个月基金份额净值为 1.0642 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.47%；同期业绩比较基准增长率为 1.27%。

#### 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。

债券市场方面，在结构性去杠杆的方针不变的情况下，债券市场的牛市仍将持续，利率仍然存在一定的下行空间，但不宜盲目追涨。信用债仍需防范信用风险，同时积极挖掘个体的超额收益。

权益市场方面，短期严峻的经济形势和中美关系摩擦仍将对企业盈利造成压制，但权益市场的估值已经较为充分地反映了上述风险，前期偏紧的监管政策也已做出调整，我们认为权益市场已经进入较佳的布局区间。市场在经历了一个季度的回调之后，国内的货币和财政政策已经有了较为积极的调整，有利于投资者风险偏好提升，市场有望在三季度出现情绪上的修复，政策放松的效果最快能在四季度得到验证。从估值上看，当前 A 股市场的估值仅次于 2013 年，处于历史估值底部区间，继续下探的空间的有限。长期而言，中国经济的增长韧性依然较强，城镇化进程推进、居民消费升级、乡村振兴等依然是经济增长的动力。我们认为现在是权益市场较好的布局时点，在标的选择上倾向于自下而上挑选价值被错杀的个股，以及业绩确定性高增长的成长股。

我们将紧密跟踪经济和市场的动态变化，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遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §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：泰康金泰回报 3 个月定期开放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             | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                                |                                  |
| 银行存款            | 177,246.06                     | 1,648,017.84                     |
| 结算备付金           | 165,233.74                     | 237,453.03                       |
| 存出保证金           | 34,225.03                      | 31,968.29                        |
| 交易性金融资产         | 91,896,502.33                  | 258,114,437.83                   |
| 其中：股票投资         | 15,739,433.43                  | 45,205,942.63                    |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 76,157,068.90                  | 212,908,495.20                   |
| 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                     |
| 应收证券清算款         | 168,680.07                     | -                                |
| 应收利息            | 1,245,784.64                   | 3,456,570.25                     |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 308,678.64                     | -                                |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| 资产总计            | 93,996,350.51                  | 266,488,447.24                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2018 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 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       | 12,049,794.47                  | 82,097,493.65                    |
| 应付证券清算款         | 28,147.38                      | 1,194,018.64                     |
| 应付赎回款           | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         | 91,260.62                      | 185,668.18                       |
| 应付托管费           | 15,210.13                      | 30,944.68                        |
| 应付销售服务费         | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 54,311.49                      | 66,185.84                        |
| 应交税费            | 10,527.66                      | -                                |

|               |               |                |
|---------------|---------------|----------------|
| 应付利息          | 3,188.18      | 116,937.01     |
| 应付利润          | -             | -              |
| 递延所得税负债       | -             | -              |
| 其他负债          | 167,967.37    | 149,000.00     |
| 负债合计          | 12,420,407.30 | 83,840,248.00  |
| <b>所有者权益：</b> |               |                |
| 实收基金          | 76,654,707.13 | 177,587,855.27 |
| 未分配利润         | 4,921,236.08  | 5,060,343.97   |
| 所有者权益合计       | 81,575,943.21 | 182,648,199.24 |
| 负债和所有者权益总计    | 93,996,350.51 | 266,488,447.24 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0642 元，基金份额总额 76,654,707.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰康金泰回报 3 个月定期开放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<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 22 日(基金<br>合同生效日)至 2017 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           | 6,197,474.24                             | 6,324,938.90  |
| 1.利息收入                | 2,685,721.29                             | 5,260,419.13  |
| 其中：存款利息收入             | 4,909.80                                 | 751,578.39  |
| 债券利息收入                | 2,670,695.56                             | 3,573,355.36  |
| 资产支持证券利息收入            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            | 10,115.93                                | 935,485.38  |
| 其他利息收入                | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | 1,848,441.03                             | -133,874.07   |
| 其中：股票投资收益             | 1,311,479.35                             | -220,228.93   |
| 基金投资收益                | -  | -   |
| 债券投资收益                | 332,855.78                               | 21,160.86   |
| 资产支持证券投资收益            | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | -  | -   |
| 衍生工具收益                | -  | -   |
| 股利收益                  | 204,105.90                               | 65,194.00   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 1,662,099.40                             | 1,127,195.83  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 1,212.52                                 | 71,198.01   |
| <b>减：二、费用</b>         | 1,893,922.64                             | 2,395,204.90  |

|                            |                     |                     |
|----------------------------|---------------------|---------------------|
| 1. 管理人报酬                   | 768,920.41          | 1,394,547.10        |
| 2. 托管费                     | 128,153.40          | 232,424.54          |
| 3. 销售服务费                   | -                   | -                   |
| 4. 交易费用                    | 150,481.27          | 62,951.97           |
| 5. 利息支出                    | 697,071.61          | 516,351.45          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 697,071.61          | 516,351.45          |
| 6. 税金及附加                   | 6,444.97            | -                   |
| 7. 其他费用                    | 142,850.98          | 188,929.84          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>4,303,551.60</b> | <b>3,929,734.00</b> |
| 减：所得税费用                    | -                   | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>4,303,551.60</b> | <b>3,929,734.00</b> |

注：本基金合同生效日为 2017 年 1 月 22 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2017 年 1 月 22 日至 2017 年 6 月 30 日止期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康金泰回报 3 个月定期开放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<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）                        | 177,587,855.27                        | 5,060,343.97  | 182,648,199.24  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 4,303,551.60  | 4,303,551.60    |
| 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）      | -100,933,148.14                       | -4,442,659.49 | -105,375,807.63 |
| 其中：1.基金申购款                             | 8,007,155.52                          | 452,276.22    | 8,459,431.74    |
| 2.基金赎回款                                | -108,940,303.66                       | -4,894,935.71 | -113,835,239.37 |
| 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）                        | 76,654,707.13                         | 4,921,236.08  | 81,575,943.21   |



| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 22 日(基金合同生效日)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<br>(基金净值)                    | 267,129,997.59                                       | -            | 267,129,997.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -  | 3,929,734.00 | 3,929,734.00   |
| 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)      | -4,018,430.07  | -24,254.30   | -4,042,684.37  |
| 其中: 1.基金申购款                            | 698,868.18   | 4,980.03     | 703,848.21     |
| 2.基金赎回款                                | -4,717,298.25  | -29,234.33   | -4,746,532.58  |
| 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<br>(基金净值)                    | 263,111,567.52                                       | 3,905,479.70 | 267,017,047.22 |

注: 本基金合同生效日为 2017 年 1 月 22 日, 上年度可比期间是指自基金合同生效日 2017 年 1 月 22 日至 2017 年 6 月 30 日止期间。

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

泰康金泰回报 3 个月定期开放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 2602 号《关于准予泰康金泰回报 3 个月定期开放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《泰康金泰回报 3 个月定期开放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、定期开放式, 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 266,974,767.22 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(2017)第 049 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《泰康金泰回报 3 个月定期开

放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 267,129,997.59 份基金份额，其中认购资金利息折合 155,230.37 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，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康金泰回报 3 个月定期开放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，包括国内依法公开发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货、国债期货、债券资产(包括但不限于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、非金融企业债务融资工具、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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的 30%；持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%；在开放期内，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，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：15%\*沪深 300 指数收益率+85%\*中债新综合财富(总值)指数收益率。

#### 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》、《泰康金泰回报 3 个月定期开放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税收政策的通知》、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[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]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》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。

(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。

## 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             |
|--------------|---------------------|
| 泰康保险集团股份有限公司 | 基金管理人股东             |
| 招商银行股份有限公司   | 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。

## 6.4.8 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 2017 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日，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>2018 年 1 月 1 日至 2018 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 22 日 (基金合同生效日)<br>至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 768,920.41                               | 1,394,547.10  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 522,029.18                               | 936,195.09  |

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 1.20% 的费率计提，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 X 1.20% / 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>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 22 日 (基金合同生效日) |
|----|---------------------------------------|--------------------------------------|
|----|---------------------------------------|--------------------------------------|

|                |            | 至2017年6月30日 |
|----------------|------------|-------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 128,153.40 | 232,424.54  |

注：支付基金托管人招商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 X 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 2017 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日，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自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间 2017 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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自有资金投资本基金。

#### 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>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月<br>30 日 |          | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至<br>2017 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    |
| 招商银行  | 177,246.06                               | 1,148.38 | 611,237.94  | 15,774.20 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

#### 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 2017 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日，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，本基金无须作说明的其他关联交易事项；上年度可比期间 2017 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日，本基金在银行间同业市场于 2017 年 2 月 22 日分销 17 招商银行 CD066，数量 500,000 张，金额 49,469,250.00 元。

## 6.4.9 期末（2018 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

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。

### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期            | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|------|--------|-------|----------|----------|----|
| 300740 | 御家汇  | 2018 年 6 月 19 日 | 重大事项停牌 | 29.91  | -    | -      | 80    | 2,676.96 | 2,392.80 | -  |

### 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 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 11,049,794.47 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|---------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 011800139 | 18 鲁钢铁 SCP002 | 2018 年 7 月 2 日 | 100.49 | 50,000  | 5,024,500.00  |
| 011800616 | 18 首钢 SCP003  | 2018 年 7 月 2 日 | 100.37 | 11,000  | 1,104,070.00  |
| 011801176 | 18 中铝集 SCP009 | 2018 年 7 月 2 日 | 100.13 | 50,000  | 5,006,500.00  |
| 合计        |               |                |        | 111,000 | 11,135,070.00 |

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,000,000.00 元，于 2018 年 7 月 2 日(先后)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## 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 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 15,737,040.63 元，属于第二层次的余额为 76,159,461.70 元，无属于第三层次的余额。（2017 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 44,320,486.63 元，属于第二层次的余额为 213,793,951.20 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

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              | 15,739,433.43 | 16.74         |
|    | 其中：股票             | 15,739,433.43 | 16.74         |
| 2  | 固定收益投资            | 76,157,068.90 | 81.02         |
|    | 其中：债券             | 76,157,068.90 | 81.02         |
|    | 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          | -             | -             |
|    | 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      | 342,479.80    | 0.36          |
| 7  | 其他各项资产            | 1,757,368.38  | 1.87          |
| 8  | 合计                | 93,996,350.51 | 100.00        |

注：本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

### 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              | 107,682.00    | 0.13          |
| C  | 制造业              | 12,458,407.87 | 15.27         |
| 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           | -             | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | 1,407,250.57  | 1.73          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -             |
| J  | 金融业              | -             | -             |
| K  | 房地产业             | 150.99        | 0.00          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 183,356.00    | 0.22          |
| 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   | 845,306.00    | 1.04  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 737,280.00    | 0.90  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 15,739,433.43 | 19.29 |

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

## 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  | 002563 | 森马服饰 | 209,300 | 2,992,990.00 | 3.67         |
| 2  | 002507 | 涪陵榨菜 | 34,400  | 883,392.00   | 1.08         |
| 3  | 002008 | 大族激光 | 15,600  | 829,764.00   | 1.02         |
| 4  | 600258 | 首旅酒店 | 29,621  | 804,802.57   | 0.99         |
| 5  | 600519 | 贵州茅台 | 1,100   | 804,606.00   | 0.99         |
| 6  | 603103 | 横店影视 | 24,000  | 737,280.00   | 0.90         |
| 7  | 603816 | 顾家家居 | 9,000   | 661,590.00   | 0.81         |
| 8  | 002044 | 美年健康 | 27,000  | 610,200.00   | 0.75         |
| 9  | 600754 | 锦江股份 | 16,300  | 602,448.00   | 0.74         |
| 10 | 603288 | 海天味业 | 8,100   | 596,484.00   | 0.73         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金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  | 000651 | 格力电器 | 2,790,144.00 | 1.53           |
| 2  | 601088 | 中国神华 | 2,620,027.00 | 1.43           |
| 3  | 601939 | 建设银行 | 1,937,949.00 | 1.06           |
| 4  | 000895 | 双汇发展 | 1,908,441.00 | 1.04           |
| 5  | 600029 | 南方航空 | 1,697,311.00 | 0.93           |
| 6  | 000002 | 万科A  | 1,517,794.00 | 0.83           |
| 7  | 601818 | 光大银行 | 1,509,451.00 | 0.83           |
| 8  | 601601 | 中国太保 | 1,504,275.00 | 0.82           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 9  | 603288 | 海天味业 | 1,487,294.00 | 0.81 |
| 10 | 000848 | 承德露露 | 1,467,816.00 | 0.80 |
| 11 | 002027 | 分众传媒 | 1,385,412.00 | 0.76 |
| 12 | 002563 | 森马服饰 | 1,322,143.00 | 0.72 |
| 13 | 601688 | 华泰证券 | 1,301,670.00 | 0.71 |
| 14 | 601318 | 中国平安 | 1,297,670.00 | 0.71 |
| 15 | 600887 | 伊利股份 | 1,097,944.00 | 0.60 |
| 16 | 601009 | 南京银行 | 1,074,720.00 | 0.59 |
| 17 | 600585 | 海螺水泥 | 1,063,088.00 | 0.58 |
| 18 | 601398 | 工商银行 | 1,035,897.00 | 0.57 |
| 19 | 600030 | 中信证券 | 999,040.00   | 0.55 |
| 20 | 002332 | 仙琚制药 | 987,540.00   | 0.54 |

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  | 600887 | 伊利股份 | 5,360,660.87 | 2.93           |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 4,687,032.93 | 2.57           |
| 3  | 000895 | 双汇发展 | 2,604,364.97 | 1.43           |
| 4  | 000002 | 万科A  | 2,556,389.00 | 1.40           |
| 5  | 600029 | 南方航空 | 2,447,639.00 | 1.34           |
| 6  | 601088 | 中国神华 | 2,424,105.00 | 1.33           |
| 7  | 601939 | 建设银行 | 2,172,341.00 | 1.19           |
| 8  | 600690 | 青岛海尔 | 2,059,985.72 | 1.13           |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 2,040,900.54 | 1.12           |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 1,941,503.00 | 1.06           |
| 11 | 002563 | 森马服饰 | 1,940,833.00 | 1.06           |
| 12 | 600398 | 海澜之家 | 1,774,167.00 | 0.97           |
| 13 | 300347 | 泰格医药 | 1,564,165.00 | 0.86           |
| 14 | 601818 | 光大银行 | 1,550,765.00 | 0.85           |
| 15 | 603288 | 海天味业 | 1,533,856.00 | 0.84           |
| 16 | 002714 | 牧原股份 | 1,517,288.00 | 0.83           |
| 17 | 600859 | 王府井  | 1,470,552.76 | 0.81           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 18 | 000848 | 承德露露 | 1,308,541.00 | 0.72 |
| 19 | 601601 | 中国太保 | 1,264,249.00 | 0.69 |
| 20 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,237,252.00 | 0.68 |

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 | 59,609,381.82 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 90,410,441.54 |

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  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 28,618,200.00 | 35.08        |
|    | 其中：政策性金融债 | 28,618,200.00 | 35.08        |
| 4  | 企业债券      | 9,998,500.00  | 12.26        |
| 5  | 企业短期融资券   | 17,055,300.00 | 20.91        |
| 6  | 中期票据      | 15,066,000.00 | 18.47        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 5,419,068.90  | 6.64         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 76,157,068.90 | 93.36        |

### 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  | 170210    | 17 国开 10         | 150,000 | 14,661,000.00 | 17.97        |
| 2  | 170215    | 17 国开 15         | 100,000 | 9,942,000.00  | 12.19        |
| 3  | 101753012 | 17 陕煤化<br>MTN001 | 50,000  | 5,054,000.00  | 6.20         |

|   |           |                   |        |              |      |
|---|-----------|-------------------|--------|--------------|------|
| 4 | 011800139 | 18 鲁钢铁<br>SCP002  | 50,000 | 5,024,500.00 | 6.16 |
| 5 | 101800377 | 18 苏国信<br>MTN001B | 50,000 | 5,019,500.00 | 6.15 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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   | 34,225.03    |
| 2  | 应收证券清算款 | 168,680.07   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,245,784.64 |
| 5  | 应收申购款   | 308,678.64   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,757,368.38 |

**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  | 110032 | 三一转债 | 981,920.00 | 1.20         |
| 2  | 113013 | 国君转债 | 864,174.30 | 1.06         |
| 3  | 128024 | 宁行转债 | 313,830.00 | 0.38         |
| 4  | 110034 | 九州转债 | 211,000.00 | 0.26         |

**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 |
| 489          | 156,758.09    | 0.00  | 0.00%      | 76,654,707.13 | 100.00%    |

### 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<br>持有本基金 | 0.00      | 0.0000%  |

### 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<br>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（2017年1月22日）基金份额总额 | 267,129,997.59 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 177,587,855.27 |
| 本报告期基金总申购份额               | 8,007,155.52   |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 108,940,303.66 |
| 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              | 76,654,707.13  |

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

本报告期本基金管理人、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

本报告期内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，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 |    |
| 方正证券股份有限公司 | 2      | 128,707,132.54 | 85.84%       | 35,046.93 | 85.88%     | -  |
| 申万宏源证券有限公司 | 2      | 21,235,405.82  | 14.16%       | 5,764.35  | 14.12%     | -  |
| 广发证券股份有限公司 | 2      | -              | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券股份有限公司 | 2      | -              | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券股份有限公司 | 2      | -              | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券股      | 2      | -              | -            | -         | -          | -  |



|                      |   |   |   |   |   |   |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 份有限公司                |   |   |   |   |   |   |
| 天风证券股<br>份有限公司       | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券股<br>份有限公司       | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券股<br>份有限公司       | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股<br>份有限公司       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金<br>融股份有限<br>公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券股<br>份有限公司       | 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 |
| 方正证券股份有限公司 | 18,560,498.34 | 44.66%       | 271,100,000.00 | 83.49%         | -    | -            |
| 申万宏源证券有限公司 | 12,971,519.59 | 31.22%       | 53,600,000.00  | 16.51%         | -    | -            |
| 广发证券股份有限公司 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 光大证券股份有限公司 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 兴业证券股份有限公司 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信证券股份有限公司 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 天风证券股份有限公司 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 安信证券股份有限公司 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东吴证券股份有限公司 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 招商证券股份有限公司 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |

|                      |               |        |   |   |   |   |
|----------------------|---------------|--------|---|---|---|---|
| 中国国际金<br>融股份有限<br>公司 | 10,023,298.90 | 24.12% | - | - | - | - |
| 东方证券股<br>份有限公司       | -             | -      | - | - | - | - |

## §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

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。

### 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

2018 年 8 月 27 日