

重要提示

基金管理人承诺基金不存在虚假记载、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法律责任。

基金管理人承诺本报告按照《证券投资基金信息披露管理办法》的要求编制，基金管理人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金的投资运作并不表示对基金管理人或基金托管人的任何保证，投资者在作出投资决策前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书及更新。
本报告财务资料未经审计。
本报告期为2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 基金名称 (Fund Name), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 报告期 (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

注：(1) 本期已实现投资收益含本期股利收入、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) 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。

基金净值表现

Table showing percentage changes in net assets and benchmark performance comparison for the reporting period.



注：1、本基金成立于2016年07月01日生效。
2、跟踪本基金的投资组合约定，基金经理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约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

其他指标

Table listing other indicators and their values for the reporting period.

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table providing biographical information and tenure for fund managers 贾成林 and 刘伟.

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，表中中的任职日期和离任日期均取自公司公开披露的日期。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守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。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况
本基金管理人公平对待其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。

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预警制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，二季度继续维持下行，且总体压力可控。从三大需求来看，投资端由于地产政策见底回暖，制造业投资持续低基数影响，增速有所下行，消费由于节假日因素波动较大，合并来看在平稳中略有下行；出口仍受到全球宏观经济下行的影响，但出口导向型行业订单、订单改善，由于春节假期结束，消费电子等行业有所好转。

报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末泰康沪港精选基金净值1.1227元，本报告期基金净值增长率为-2.53%，同期业绩比较基准增长率为-0.92%。

报告期末基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内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况。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table showing the composition of the fund's assets at the end of the reporting period, including equity, fixed income, and cash.

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672,069,209.41元，占期末资产净值的比例为72.27%。

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing the industry classification of stocks held by the fund at the end of the reporting period.

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table showing the industry classification of stocks held by the fund through the HKSC Scheme at the end of the reporting period.

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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

Table listing the top 10 stocks held by the fund based on their fair value as a percentage of net assets.

注：对于同时在A股和H股上市的股票，合并计算公允价值并排序，并按原币种分别列示。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing the breakdown of bonds held by the fund at the end of the reporting period.

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

Table listing the top 5 bonds held by the fund based on their fair value as a percentage of net assets.

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

Table showing the top 5 precious metal investments held by the fund at the end of the reporting period.

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

无。

报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

无。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table showing the positions and P&L for index futures investments held by the fund at the end of the reporting period.

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，结合自身投资组合的特点，与现货资产进行匹配，通过套期保值实现进行套期保值操作，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。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

本期国债期货投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table showing the positions and P&L for国债期货 investments held by the fund at the end of the reporting period.

本期国债期货投资评价

无。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
本基金报告期内基金前十名证券发行人未出现监管部门立案调查的情况，不存在编制前一年度内未受到公开谴责、处罚。

声明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
本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。

Table showing the composition of other assets held by the fund at the end of the reporting period.

Table showing the positions and P&L for convertible bond investments held by the fund at the end of the reporting period.

Table showing the positions and P&L for convertible bond investments held by the fund at the end of the reporting period.

Table showing the positions and P&L for convertible bond investments held by the fund at the end of the reporting period.

Table showing the positions and P&L for convertible bond investments held by the fund at the end of the reporting period.

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康沪港精选灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
(二) 《泰康沪港精选灵活配置混合型证券投资基金合同》；
(三) 《泰康沪港精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
(四) 《泰康沪港精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

存放地点

基金管理人和本基金托管人的住所。

查阅方式

投资者可通过指定信息披露媒体(《上海证券报》)或基金管理人网站(http://www.tkfunds.com.cn)查阅。