

泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 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。

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 2021 年 10 月 26 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 2021 年 7 月 1 日起至 2021 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 |
| 交易代码 | 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 | 1,562,525,226.06 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 |

§ 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（2021年7月1日—2021年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 37,373,517.57 |
| 2. 本期利润 | -39,743,980.00 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0213 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,274,746,335.95 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4558 |

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）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

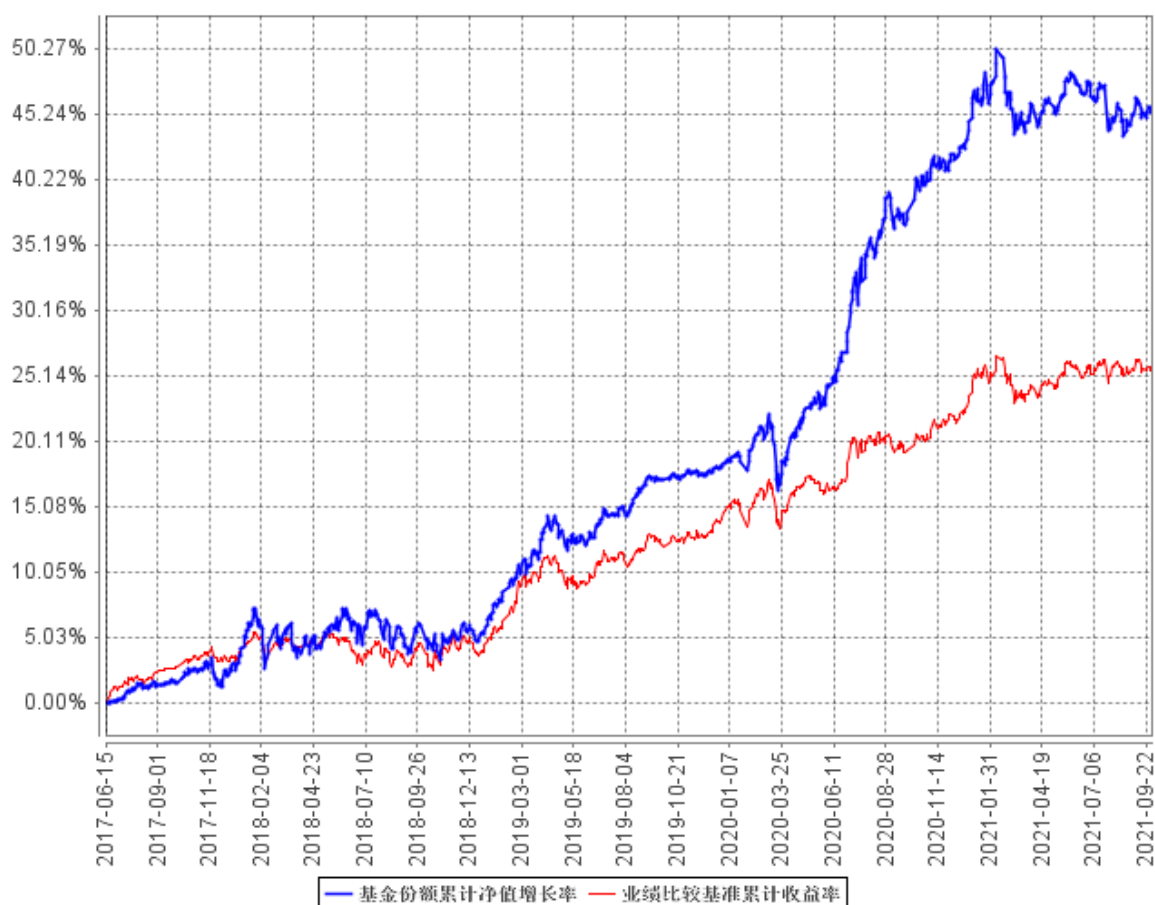
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | -1.22% | 0.34% | -0.11% | 0.25% | -1.11% | 0.09% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月 | 0.66% | 0.30% | 1.55% | 0.22% | -0.89% | 0.08% |
| 过去一年 | 5.80% | 0.35% | 5.37% | 0.25% | 0.43% | 0.10% |
| 过去三年 | 37.30% | 0.34% | 20.26% | 0.26% | 17.04% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 45.58% | 0.34% | 25.71% | 0.25% | 19.87% | 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

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 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。

§ 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、公募事业部固定收益投资负责人 | 2017 年 6 月 15 日 | - | 13 | 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负责人。2015 年 6 月 19 日至今担任泰康新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 |

| | | | | | |
|-----|--------------------|-----------------|---|----|---|
| | | | | | <p>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 日至今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。</p> |
| 桂跃强 | 本基金经理、公募事业部权益投资负责人 | 2017 年 6 月 15 日 | - | 13 | <p>桂跃强于 2015 年 8 月加入泰康资产，现担任公募事业部股票投资负责人。2007 年 9 月至 2015 年 8 月曾任职于新华基金管理有限责任公司，担任基金管理部副总监。历任新华泛资源优势灵活配置混合型证券投</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2018年8月23日至今</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 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。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。 |
|--|--|--|--|--|--|

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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，三季度经济下行压力有所加大，内需和出口走势分化。出口在中国供应链优势下，增速一直维持高位，但内需下滑较为明显，主要体现在受疫情影响严重的消费、以及受调控政策影响的地产销售和投资。基建和制造业相对较为稳定，但制造业在需求下行、成本压力抬升的背景下，盈利开始承压。在能源双控的背景下，不少上游价格持续上涨，带动 PPI 向上超预期，CPI 则继续处于低位相对平稳的走势中。在这一环境下，实体的融资需求继续偏弱，叠加地产行业的政策限制，社融增速有所下行。

债券市场方面，三季度收益率震荡下行，10Y 国债和国开分别下行了 22 和 30bp。7 月份的超预期降准是三季度行情的核心驱动力，证伪了市场此前关于货币政策可能的收紧预期。此后，经济下行压力逐步显现，也对债券市场形成支撑。但流动性并未随着降准而有进一步宽松，资金利率在降准前面保持相对稳定，收益率曲线走向平坦化。8-9 月由于美债上行、债券供给边际加快、理财净值化转型加速等原因，收益率整体呈现区间窄幅震荡的走势；信用债收益率由于事件冲击和理财整改而有所波动。

3 季度全球股市而言成熟市场表现平稳，而中国相关的资产表现分化明显。恒指 3 季度大跌 14.75%，沪深 300 下跌 6.85%，结构方面，新能源和原材料板块轮番上涨。整体反映了市场的流动性仍然充裕，投资者认识到宏观经济平稳向下，原材料短期因为供给的问题受到追捧，而新能源板块则因为碳中和具备长期的投资空间。

具体投资策略上，在利率债方面，在总体维持中性久期的基础上，操作上保持一定的灵活性，根据市场节奏进行适度调整；在信用债方面，继续严格防范信用风险，根据中微观的变化情况，对行业和主体的深入研究和投资，积极挖掘具备一定票息价值的个券，同时关注信用风险事件的市场影响。

权益投资方面，在本期，基金的仓位略有下降，配置上我们继续持有食品饮料、品牌家电、医疗装备、化工等行业的龙头公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康兴泰回报沪港深基金份额净值为 1.4558 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.22%；同期业绩比较基准增长率为-0.11%。

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 | 425,300,329.13 | 13.62 |
| | 其中：股票 | 425,300,329.13 | 13.62 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,615,708,736.61 | 83.75 |
| | 其中：债券 | 2,601,838,736.61 | 83.31 |
| | 资产支持证券 | 13,870,000.00 | 0.44 |
| 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 | 36,441,184.22 | 1.17 |
| 8 | 其他资产 | 45,781,400.89 | 1.47 |
| 9 | 合计 | 3,123,231,650.85 | 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 75,336,520.00 元，占期末资产净值比例为 3.31%。

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 | 18,116.82 | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 317,071,894.15 | 13.94 |
| 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 | 51,352.71 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,431,865.55 | 0.28 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,345.12 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,551,917.59 | 0.20 |
| J | 金融业 | 21,584,624.89 | 0.95 |
| 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 | 197,776.20 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 52,916.10 | 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 | 349,963,809.13 | 15.38 |

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 | - | - |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | - | - |
| H 信息技术 | - | - |
| I 电信服务 | 75,336,520.00 | 3.31 |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 75,336,520.00 | 3.31 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 | 600519 | 贵州茅台 | 51,200 | 93,696,000.00 | 4.12 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 196,000 | 75,336,520.00 | 3.31 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 200,821 | 44,058,119.19 | 1.94 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 378,100 | 26,315,760.00 | 1.16 |
| 5 | 600809 | 山西汾酒 | 73,080 | 23,056,740.00 | 1.01 |
| 6 | 601939 | 建设银行 | 2,680,400 | 16,001,988.00 | 0.70 |
| 7 | 300760 | 迈瑞医疗 | 37,602 | 14,492,562.84 | 0.64 |
| 8 | 600031 | 三一重工 | 559,147 | 14,224,699.68 | 0.63 |
| 9 | 000932 | 华菱钢铁 | 1,771,046 | 11,742,034.98 | 0.52 |
| 10 | 002311 | 海大集团 | 158,476 | 10,681,282.40 | 0.47 |

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 | 1,000,900.00 | 0.04 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 352,827,400.00 | 15.51 |
| | 其中：政策性金融债 | 352,827,400.00 | 15.51 |
| 4 | 企业债券 | 421,633,300.00 | 18.54 |
| 5 | 企业短期融资券 | 325,881,250.00 | 14.33 |
| 6 | 中期票据 | 1,320,151,400.00 | 58.04 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 180,344,486.61 | 7.93 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,601,838,736.61 | 114.38 |

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 | 180210 | 18 国开 10 | 900,000 | 94,356,000.00 | 4.15 |
| 2 | 190202 | 19 国开 02 | 840,000 | 84,193,200.00 | 3.70 |
| 3 | 190205 | 19 国开 05 | 700,000 | 70,910,000.00 | 3.12 |
| 4 | 190210 | 19 国开 10 | 500,000 | 51,190,000.00 | 2.25 |
| 5 | 210206 | 21 国开 06 | 420,000 | 42,025,200.00 | 1.85 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 169272 | 博雅 1A | 138,700 | 13,870,000.00 | 0.61 |

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

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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受到调查以及处罚的情况的说明

国家开发银行因为违规的政府购买服务项目提供融资等原因在本报告编制前一年内受到中国银保监会的行政处罚。

腾讯控股有限公司因构成违法实施的经营集中等原因在本报告编制前一年内受到国家市场监督管理总局的行政处罚。

基金投资上述主体相关证券的决策流程符合公司投资制度的规定。

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 38,551.57 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,859,551.91 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 42,883,297.41 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 45,781,400.89 |

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 | 128029 | 太阳转债 | 18,394,646.40 | 0.81 |

| | | | | |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 2 | 113011 | 光大转债 | 12,162,454.70 | 0.53 |
| 3 | 123099 | 普利转债 | 9,472,500.00 | 0.42 |
| 4 | 132018 | G 三峡 EB1 | 7,948,530.00 | 0.35 |
| 5 | 110075 | 南航转债 | 6,694,140.00 | 0.29 |
| 6 | 113602 | 景 20 转债 | 6,189,225.00 | 0.27 |
| 7 | 110053 | 苏银转债 | 5,798,301.60 | 0.25 |
| 8 | 110062 | 烽火转债 | 5,051,337.50 | 0.22 |
| 9 | 128129 | 青农转债 | 5,037,642.54 | 0.22 |
| 10 | 128119 | 龙大转债 | 4,964,445.45 | 0.22 |
| 11 | 123078 | 飞凯转债 | 4,409,100.00 | 0.19 |
| 12 | 123091 | 长海转债 | 3,662,538.40 | 0.16 |
| 13 | 113043 | 财通转债 | 3,454,222.80 | 0.15 |
| 14 | 127005 | 长证转债 | 3,341,342.40 | 0.15 |
| 15 | 128141 | 旺能转债 | 3,317,193.00 | 0.15 |
| 16 | 128109 | 楚江转债 | 3,244,026.80 | 0.14 |
| 17 | 123070 | 鹏辉转债 | 2,854,691.80 | 0.13 |
| 18 | 128071 | 合兴转债 | 2,848,095.00 | 0.13 |
| 19 | 113603 | 东缆转债 | 2,812,423.60 | 0.12 |
| 20 | 128048 | 张行转债 | 2,768,536.68 | 0.12 |
| 21 | 128107 | 交科转债 | 1,811,667.00 | 0.08 |
| 22 | 110051 | 中天转债 | 1,775,700.00 | 0.08 |
| 23 | 127025 | 冀东转债 | 1,737,900.00 | 0.08 |
| 24 | 110060 | 天路转债 | 1,631,626.50 | 0.07 |
| 25 | 113616 | 韦尔转债 | 1,540,425.00 | 0.07 |
| 26 | 127026 | 超声转债 | 1,503,828.34 | 0.07 |
| 27 | 123104 | 卫宁转债 | 1,496,583.20 | 0.07 |
| 28 | 110041 | 蒙电转债 | 1,464,900.00 | 0.06 |
| 29 | 113615 | 金诚转债 | 1,435,835.40 | 0.06 |
| 30 | 123025 | 精测转债 | 1,419,737.00 | 0.06 |
| 31 | 113618 | 美诺转债 | 1,386,820.80 | 0.06 |
| 32 | 113593 | 沪工转债 | 1,231,500.00 | 0.05 |
| 33 | 113608 | 威派转债 | 1,156,100.00 | 0.05 |
| 34 | 128081 | 海亮转债 | 1,003,908.00 | 0.04 |

| | | | | |
|----|--------|-------|------------|------|
| 35 | 127015 | 希望转债 | 924,858.00 | 0.04 |
| 36 | 128035 | 大族转债 | 849,300.00 | 0.04 |
| 37 | 123056 | 雪榕转债 | 675,057.00 | 0.03 |
| 38 | 110076 | 华海转债 | 638,787.60 | 0.03 |
| 39 | 110070 | 凌钢转债 | 630,600.00 | 0.03 |
| 40 | 110047 | 山鹰转债 | 595,677.60 | 0.03 |
| 41 | 128090 | 汽模转 2 | 569,700.00 | 0.03 |
| 42 | 128108 | 蓝帆转债 | 569,450.00 | 0.03 |
| 43 | 123044 | 红相转债 | 487,548.60 | 0.02 |
| 44 | 123061 | 航新转债 | 449,577.80 | 0.02 |
| 45 | 113568 | 新春转债 | 312,268.00 | 0.01 |
| 46 | 127020 | 中金转债 | 188,023.20 | 0.01 |
| 47 | 123022 | 长信转债 | 68,990.40 | 0.00 |
| 48 | 113582 | 火炬转债 | 29,857.50 | 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

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,162,036,890.34 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 20,473,862.67 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 619,985,526.95 |
| 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 | 1,562,525,226.06 |

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。

§ 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。

泰康资产管理有限责任公司

2021 年 10 月 27 日