

目录
重要提示
基金管理人承诺
基金托管人承诺
基金投资运作情况
基金业绩表现
基金净值表现
基金管理人报告
基金投资组合报告
基金管理人内部控制制度
基金管理人内部控制制度
基金管理人内部控制制度

重要提示

基金管理人承诺：基金管理人承诺不以虚假记载、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。

基金托管人承诺：基金托管人承诺不以虚假记载、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。

基金投资运作情况：基金投资运作情况，报告期内基金投资运作合规性情况，报告期内基金投资策略执行情况，报告期内基金业绩表现情况等。

基金业绩表现：基金业绩表现，报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较。

基金净值表现：基金净值表现，报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较。

基金管理人报告：基金管理人报告，报告期内基金管理人履行职责的情况。

基金投资组合报告：基金投资组合报告，报告期内基金投资组合的情况。

基金管理人内部控制制度：基金管理人内部控制制度，报告期内基金管理人内部控制制度的执行情况。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 基金名称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Report End Total Fund Shares), 投资目标 (Investment Objective), 投资策略 (Investment Strategy), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian).

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可能低于所列数字。

基金净值表现

Table with columns: 本报告期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 (Comparison of Net Value Growth Rates).

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 (Comparison of Cumulative Net Value Growth Rates).



注：1. 本基金基金合同于2017年06月15日生效。 2. 按照本基金基金合同约定，本基金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。

其他指标

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

基金管理人(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金基金经理 (Served as Fund Manager), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (Resignation Date), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks).

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。表中任职日期和离任日期均以基金公司公告的日期为准。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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 (Fair Trading Policy Implementation): 本基金管理人公平对待管理的所有基金组合，建立了公平交易制度流程，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公平交易。

异常交易行为的专项说明 (Special Statement on Abnormal Trading Behavior): 本基金管理人建立了异常交易的监控与报告机制，对异常交易行为进行事前、事中和事后的控制。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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面：二季度经济继续小幅下行，经济压力可控。从三大需求来看，投资由于地产投资呈现边际回落，制造业投资持续低迷的影响，增速有所下滑。消费由于节假日消费拉动较大，消费升级在平中趋小下行，出口仍然受到全球经济下行负面影响，但出口效应边际改善。通胀方面，CPI有所上行，但核心通胀有所走低。货币条件来看，货币市场利率保持平稳，汇率由中美关系边际恶化的影响有所上行。

债券市场方面：利率区间震荡，总体小幅上行。4月以来由于三季报业绩超预期影响，风险偏好持续提升的影响，利率明显上行。随后，海外利率下行和中美贸易升温两个因素使得国内利率有所下行。6月市场多空交织，债市政策或力行的市场预期限制了利率进一步上行。二季度来看，10国债上行10bp，10国债上行3bp，交易量是二季度最高的水平。

权益市场方面：沪深两市中美贸易升温影响有所上行，但核心通胀有所走低。货币条件来看，货币市场利率保持平稳，汇率由中美关系边际恶化的影响有所上行。沪深两市中美贸易升温影响有所上行，但核心通胀有所走低。货币条件来看，货币市场利率保持平稳，汇率由中美关系边际恶化的影响有所上行。

投资策略方面：我们坚持长期稳健的思路，从资产配置、企业估值等角度构建投资组合，根据市场的估值水平对仓位进行了一定的调整。

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深深混合型证券投资基金净值为1.160元，本报告期基金份额净值增长率为1.38%，同期业绩比较基准增长率为0.36%。

报告期内基金份额持有人或基金资产净值情况说明

本报告期内本基金未发生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况。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额(元) (Amount in RMB Yuan), 占基金总资产的比例(%) (Percentage of Total Assets).

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5,889,838.29元，占期末资产净值比例为47%。

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

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 with columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

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

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

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 with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity in Tens of Thousands of RMB Yuan), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 (Report End Futures Holdings and P/L Summary):

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position Size Buy/Sell), 合约价值(元) (Contract Value in RMB Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险说明 (Risk Description).

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 (Report End Treasury Futures Trading Status):

本期国债期货交易政策 (Current Treasury Futures Trading Policy):

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Treasury Futures Holdings and P/L Summary):

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position Size Buy/Sell), 合约价值(元) (Contract Value in RMB Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险说明 (Risk Description).

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

投资组合报告附注 (Investment Portfolio Report Notes):

受到调查以及处罚的情况 (Investigation and Penalties): 本报告期内本基金投资前十名证券发行人未出现被监管部门立案调查的情况，且未受到公开谴责、处罚。

申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 (Declaration on Top 10 Stocks): 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

基金资产构成

Table with columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in RMB Yuan), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

1. 由于持仓巨大的原因，分派之和与合计项之间可能存在误差。 2. 报告期内没有说明的证券投资情况。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 数量 (Quantity), 单位: 份 (Unit: Shares).

注：报告期内基金申购赎回份额含红利再投资、转入份额。基金总申购份额含转换转入。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目 (Item), 基金份额 (Fund Shares), 单位: 份 (Unit: Shares).

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金基金份额。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Type), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额(份) (Transaction Shares), 交易金额(元) (Transaction Amount in RMB Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金基金份额。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有份额数量 (Held Shares), 持有基金份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额数量 (Initiated Shares), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额锁定期限 (Lock-up Period for Initiated Shares).

报告期内持有基金份额持有人数量或基金份额集中度超标情况的说明

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval for 20% Shareholding), 期初份额 (Start Period Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Held Shares), 份额占比 (Shareholding Ratio).

注：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超过20%的情况。

影响投资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兴泰回报沪深深混合型证券投资基金注册的文件； (二) 《泰康兴泰回报沪深深混合型证券投资基金合同》； (三) 《泰康兴泰回报沪深深混合型证券投资基金托管协议》； (四) 《泰康兴泰回报沪深深混合型证券投资基金招募说明书》。

存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸《中国证券报》或基金管理人网站网址 (http://www.tkfunds.com.cn) 查阅。