

泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券 投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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 2019 年 8 月 23 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金
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	58,464,159.12 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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		段国圣	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰康资产管理有限责任公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层

§ 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	3,044,089.75
本期利润	4,365,084.13
加权平均基金份额本期利润	0.0792
本期加权平均净值利润率	7.17%
本期基金份额净值增长率	7.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	6,785,683.20
期末可供分配基金份额利润	0.1161
期末基金资产净值	65,907,220.56
期末基金份额净值	1.1273
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	12.73%

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。

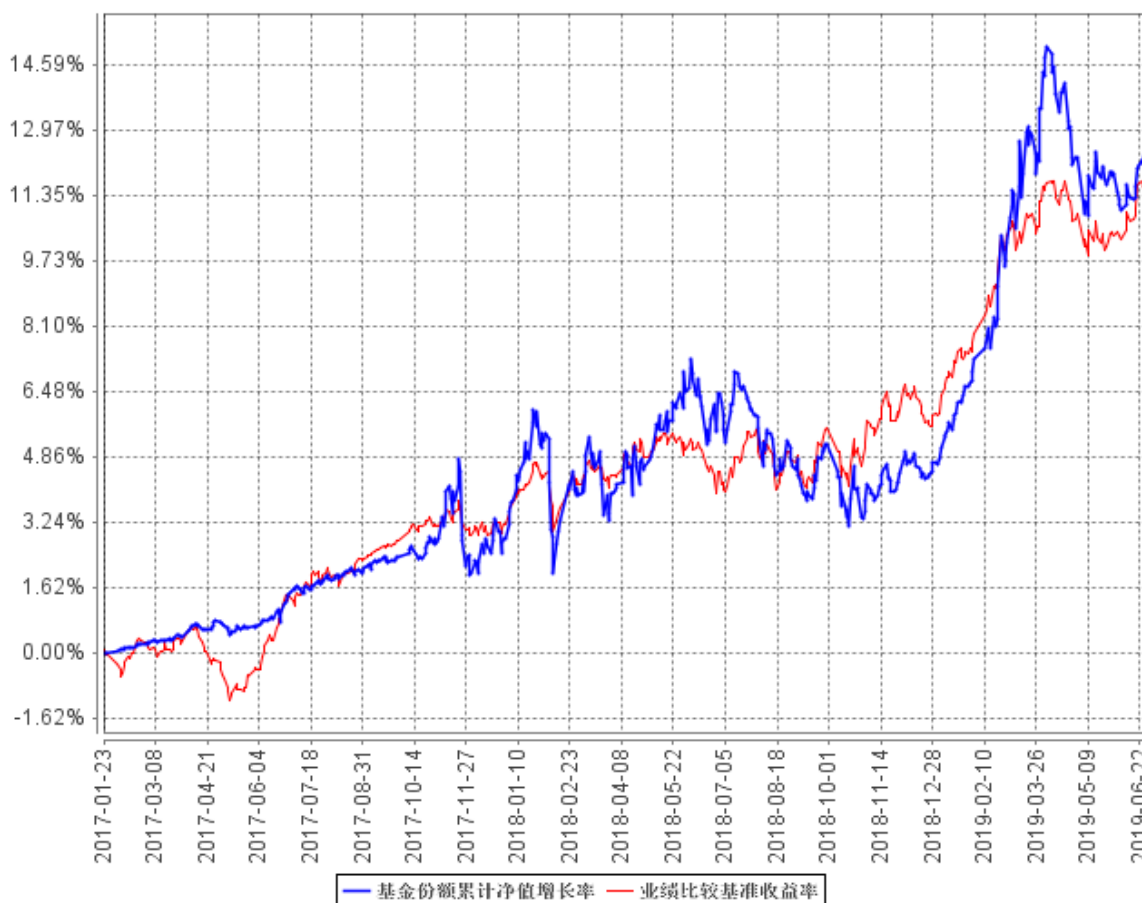
3.2 基金净值表现

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	0.75%	0.21%	1.26%	0.16%	-0.51%	0.05%
过去三个月	-0.69%	0.35%	0.46%	0.21%	-1.15%	0.14%
过去六个月	7.64%	0.39%	5.46%	0.22%	2.18%	0.17%
过去一年	5.93%	0.33%	6.90%	0.22%	-0.97%	0.11%
自基金合同生效起至今	12.73%	0.29%	11.73%	0.18%	1.00%	0.11%

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 01 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 2018 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 14000 亿元。除管理泰康委托的资产外，泰康资产管理的第三方业务总规模突破 7500 亿元，另类投资管理规模超过 3300 亿元。目前泰康资产退休金管理规模超过 2800 亿元，其中企业年金管理规模超过 2300 亿元，是国内最大的企业年金投资管理人。

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 2019 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、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康安业政策性金融债债券型证券投资基金共 35 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		
陈怡	本基金基金经理	2017 年 10 月 13 日	-	7	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、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基金经理。2017 年 4 月 19 日至 2019 年 5 月 8 日任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。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。2018 年 1 月 19 日至 2019 年 5 月 8 日任泰康均衡优选混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 23 日至今担任泰康弘实 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 3 月 22 日至今担任泰康裕泰债券型证券投资基金基金经理。
蒋利娟	本基金基金经理	2017 年 1 月 22 日	-	11	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执行总监。2015

				<p>年 6 月 19 日至今担任泰康薪意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。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。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。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。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 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 日至今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 日至今担任泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。</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

宏观经济方面，2019 年上半年经济平稳中小幅下滑，总体下行压力可控。出口的增速受到外需走弱、全球贸易割裂的影响有所下滑，是上半年经济较大的拖累项；同时，制造业投资受到出口的影响表现较弱，从而拖累总体投资增速有所下行。但消费增速受益于居民可支配收入的提升而有所上行，对经济形成支撑。通胀方面呈现了 CPI 向上、PPI 向下的格局。货币条件方面，M2 保持稳定；社融受益于宽信用政策的传导而明显改善；汇率则先升值后贬值，总体稳定。

债券市场方面，上半年利率区间震荡，总体变动较小。年初随着资金面宽松，利率有所下行，但随后一季度经济金融数据好于预期，风险偏好持续回升，利率有所反弹；4 月下旬开始，基本面边际走弱，中美贸易前景有所恶化，同时海外宽松预期再起，利率重回下行通道。总体来看，上半年 10 年国债收益率保持不变，10 年国开小幅下行 3bp。

权益市场方面，在经过 2018 年的大幅下跌后，权益风险溢价已经接近历史新高，权益资产的性价比凸显；在货币和财政政策持续放松的背景下，市场对经济硬着陆的担忧有所缓解，风险偏好回升；同时一季度处于财报真空期，市场资金对基本面的敏感度下降。基于此，一季度权益市场大幅上涨。进入二季度，中国经济数据开始持续回落，整体经济仍处于下行趋势中，但政策对冲避免了失速下滑的风险，国际贸易争端的反复以及国内金融供给侧改革的阵痛成为本期压制市场风险偏好的重要因素。同时估值结构性分化严重，A 股市场整体估值处于历史中枢以下，但大部分行业龙头的估值已经创历史新高。从数据和板块上看，上证综指上涨 19.45%，沪深 300 上涨 27.07%，中小板指上涨 20.75%，创业板指上涨 20.87%；农林牧渔、非银金融、食品饮料、家电等

板块表现相对较好，传媒、汽车、钢铁建筑等行业表现不佳。

固收投资方面，我们不断审视市场的变化，灵活进行调整。利率债上，我们合理控制久期，跟据市场形势进行波段操作，但总体上久期较为稳定，不过度进取或保守；信用债上，违约风险仍持续爆发，严控主体资质、进行个券化的精挑细选仍是主要思路。我们积极关注优质企业的超调机会，积极防范尾部风险，对于低资质品种仍继续规避。

权益投资方面，在一季度，我们减持了高股息的稳定类品种，增配了非银、农业、计算机和医药等板块。同时对后市保持谨慎乐观，密切关注政策和流动性的变化以及海外的风险传导，重点配置穿越周期的成长型板块，同时阶段性参与周期性板块的轮动机会。在二季度，长期有竞争优势、短期业绩确定性强的龙头白马成为弱市中的较优选择。我们降低了仓位，减持了前期涨幅较大的非银、养殖、白酒等板块，更为注重自下而上选股，重点配置能够穿越周期的成长性板块和估值尚未泡沫化的行业龙头。

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 1.1273 元,本报告期基金份额净值增长率为 7.64%；同期业绩比较基准增长率为 5.46%。

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 2019 年下半年，基本面下行的压力没有完全释放，但预计下行斜率缓慢。全球贸易环境割裂、外需维持低位，对出口的造成负面影响；同时地产投资随着前期拿地和新开工的下行，地产资金链边际趋紧，也将步入下行通道，但另一方面，基建投资有望形成对冲，消费在汽车缓慢复苏的背景下也有所支持。政策上将在稳增长和防风险之间保持平衡和灵活性，财政政策继续落实减税降费、盘活存量；货币政策将保持流动性合理充裕，同时加速推进利率市场化改革，引导实际贷款利率的下行。

债券市场方面，债券市场震荡的格局预计将维持。基本面边际向下的大方向、流动性保持合理充裕的条件下，利率很难进入明显的熊市，但当前利率水平较低，政策也保持定力，不宜追涨杀跌，若有调整则可能带来交易性机会。信用债将以中高等级信用债为主，主体的精挑细选仍是主要思路。

权益市场方面，展望下半年，权益市场的机会将会是结构性的。基本面仍在 L 型磨底，温和的政策环境消除了经济失速下滑的风险；在流动性维持合理充裕的背景下，风险偏好的回升主要来自政策制定者以开放促改革的决心，面对外部不利因素冲击，政策依然保持了战略定力“做好自己的事”，我们对中国经济长期转型成功依然有信心。经过前期上涨，大部分龙头白马公司的估值已经得到极大修复，但在基本面尚未破局前，这些公司仍将享受确定性溢价，我们仍配置其

中尚未泡沫化的个股；在潜在的成长股方面，消费和科技为组合重点挖掘的方向。

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，设有公募估值小组，并制定了相关制度及流程。公司公募估值小组设成员若干名，成员由公募各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理部、投资部、监察稽核部等。公募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，本基金管理人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：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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、投资组合报告内容真实、准确，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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	284,894.55	51,092.89
结算备付金		998,095.69	402,575.90
存出保证金		10,026.71	12,287.41
交易性金融资产	6.4.7.2	87,230,401.70	99,058,188.60
其中：股票投资		9,070,239.60	9,188,730.40
基金投资		-	-
债券投资		78,160,162.10	89,869,458.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	101,187.90
应收利息	6.4.7.5	1,756,015.16	1,609,972.35
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		90,279,433.81	101,235,305.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		24,199,785.00	32,899,766.10
应付证券清算款		7,652.37	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		64,389.50	69,392.69
应付托管费		10,731.62	11,565.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,190.22	13,079.72
应交税费		5,906.16	5,716.06

应付利息		3,191.36	32,225.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	66,367.02	39,000.00
负债合计		24,372,213.25	33,070,745.15
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	58,464,159.12	65,086,508.56
未分配利润	6.4.7.10	7,443,061.44	3,078,051.34
所有者权益合计		65,907,220.56	68,164,559.90
负债和所有者权益总计		90,279,433.81	101,235,305.05

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1273 元，基金份额总额 58,464,159.12 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		5,200,912.86	6,197,474.24
1.利息收入		1,467,763.99	2,685,721.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,757.40	4,909.80
债券利息收入		1,460,933.17	2,670,695.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		73.42	10,115.93
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,373,054.50	1,848,441.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,370,554.25	1,311,479.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	907,595.50	332,855.78
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	94,904.75	204,105.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,320,994.38	1,662,099.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	39,099.99	1,212.52
减：二、费用		835,828.73	1,893,922.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	360,987.55	768,920.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	60,164.65	128,153.40
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	38,359.15	150,481.27
5. 利息支出		279,311.45	697,071.61
其中：卖出回购金融资产支出		279,311.45	697,071.61
6. 税金及附加		3,733.88	6,444.97
7. 其他费用	6.4.7.20	93,272.05	142,850.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,365,084.13	4,303,551.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,365,084.13	4,303,551.60

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	65,086,508.56	3,078,051.34	68,164,559.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,365,084.13	4,365,084.13
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）	-6,622,349.44	-74.03	-6,622,423.47
其中：1.基金申购款	15,922,428.84	1,896,751.54	17,819,180.38
2.基金赎回款	-22,544,778.28	-1,896,825.57	-24,441,603.85
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）	58,464,159.12	7,443,061.44	65,907,220.56
项目	上年度可比期间 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

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：

<u>段国圣</u>	<u>金志刚</u>	<u>李俊佑</u>
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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等本基金的业绩比较基准为： $15\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 85\% \times \text{中债新综合财富（总值）指数收益率}$ 。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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[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》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管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% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额

的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	284,894.55
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	284,894.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,160,820.92	9,070,239.60	909,418.68
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	40,059,162.10	554,648.80
	银行间市场	38,101,000.00	672,308.88
	合计	78,160,162.10	1,226,957.68
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	85,094,025.34	87,230,401.70	2,136,376.36

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	29.77
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	449.10
应收债券利息	1,755,531.79
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.50
合计	1,756,015.16

6.4.7.6 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,066.28
银行间市场应付交易费用	9,123.94
合计	14,190.22

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	66,367.02
合计	66,367.02

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	65,086,508.56	65,086,508.56
本期申购	15,922,428.84	15,922,428.84
本期赎回(以“-”号填列)	-22,544,778.28	-22,544,778.28
本期末	58,464,159.12	58,464,159.12

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,805,178.35	-727,127.01	3,078,051.34
本期利润	3,044,089.75	1,320,994.38	4,365,084.13
本期基金份额交易产生的变动数	-63,584.90	63,510.87	-74.03
其中：基金申购款	1,794,777.09	101,974.45	1,896,751.54
基金赎回款	-1,858,361.99	-38,463.58	-1,896,825.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,785,683.20	657,378.24	7,443,061.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	1,083.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,585.12
其他	88.95
合计	6,757.40

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	21,906,227.11
减：卖出股票成本总额	20,535,672.86
买卖股票差价收入	1,370,554.25

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	907,595.50
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	907,595.50

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	62,179,112.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	60,191,737.77
减：应收利息总额	1,079,779.05
买卖债券差价收入	907,595.50

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期，本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	94,904.75
基金投资产生的股利收益	-
合计	94,904.75

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,320,994.38
——股票投资	1,208,897.42
——债券投资	112,096.96
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	1,320,994.38

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	39,059.77
基金转换费收入	40.22
合计	39,099.99

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金转换费用由申购费补差和转出基金赎回费两部分构成。其中：申购费补差收取具体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	36,796.65
银行间市场交易费用	1,562.50
合计	38,359.15

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	42,490.63
其他	600.00
债券帐户维护费	18,000.00
银行费用	17,305.03
合计	93,272.05

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 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，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	360,987.55	768,920.41
其中：支付销售机构的客	245,664.58	522,029.18

户维护费		
------	--	--

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,164.65	128,153.40

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。

6.4.10.3 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，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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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固有资金投资本基金。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	284,894.55	1,083.33	177,246.06	1,148.38

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。

6.4.10.6 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，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配。

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019年6月20日	2019年7月8日	网下新债流通受限	100.00	100.00	180	18,000.00	18,000.00	-
112922	19蛇口02	2019年6月25日	2019年7月4日	网下新债流通受限	100.00	100.00	30,000	3,000,000.00	3,000,000.00	-

注：截至本报告期末 2019 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股票。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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 9,999,785.00 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
160213	16国开13	2019年7月4日	95.47	100,000	9,547,000.00
170215	17国开15	2019年7月4日	102.76	7,000	719,320.00
合计				107,000	10,266,320.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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 14,200,000.00 元，于 2019 年 7 月 1 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，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。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，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。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制订了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交

割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由资产支持证券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由同业存单发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	46,712,441.00	30,762,382.10
AAA 以下	16,762,721.10	24,223,076.10
未评级	0.00	0.00
合计	63,475,162.10	54,985,458.20

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由资产支持证券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	19,769,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	19,769,000.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由同业存单发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余可在证券交易所上市交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2019 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 24199785.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

股票流动性方面，以 2019 年 06 月 30 日持仓为基础数据，假设股票交易的市场参与度为 5%，基金持仓的股票资产均可在 2 天内变现；在假设股票交易市场参与度为 5%，且市场成交量下跌 30% 的不利情况下，基金持仓的股票资产均可在 4 天内变现；公司旗下全部开放式基金持有一家上市公司发行的股票无超过该公司可流通股票的 15% 的情况。债券流动性主要受信用风险影响，截止 2019 年 06 月 30 日，基金持仓债券均为高等级债券且未持仓市场负面债券，因此债券流动性较好。基金流通受限股票资产比例为 0，5 日可变现资产比例不低于 20%。假设赎回比例 30% 的条件下(发生重大巨额赎回)，5 日可变现资产比例-投资者赎回比例均大于 0，基金流动性风险较低。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	284,894.55	-	-	-	284,894.55
结算备付金	998,095.69	-	-	-	998,095.69
存出保证金	10,026.71	-	-	-	10,026.71
交易性金融资产	27,918,669.20	35,556,492.90	14,685,000.00	9,070,239.60	87,230,401.70
应收利息	-	-	-	1,756,015.16	1,756,015.16
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	29,211,686.15	35,556,492.90	14,685,000.00	10,826,254.76	90,279,433.81
负债					
卖出回购金融资产款	24,199,785.00	-	-	-	24,199,785.00
应付证券清算款	-	-	-	7,652.37	7,652.37
应付管理人报酬	-	-	-	64,389.50	64,389.50
应付托管费	-	-	-	10,731.62	10,731.62
应付交易费用	-	-	-	14,190.22	14,190.22
应付利息	-	-	-	3,191.36	3,191.36
应交税费	-	-	-	5,906.16	5,906.16
其他负债	-	-	-	66,367.02	66,367.02
负债总计	24,199,785.00	-	-	172,428.25	24,372,213.25
利率敏感度缺口	5,011,901.15	35,556,492.90	14,685,000.00	10,653,826.51	65,907,220.56
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2018 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	51,092.89	-	-	-	51,092.89
结算备付金	402,575.90	-	-	-	402,575.90
存出保证金	12,287.41	-	-	-	12,287.41
交易性金融资产	48,865,780.00	24,214,832.10	16,788,846.10	9,188,730.40	99,058,188.60
应收证券清算款	-	-	-	101,187.90	101,187.90
应收利息	-	-	-	1,609,972.35	1,609,972.35
资产总计	49,331,736.20	24,214,832.10	16,788,846.10	10,899,890.65	101,235,305.05
负债					
卖出回购金融资产款	32,899,766.10	-	-	-	32,899,766.10
应付管理人报酬	-	-	-	69,392.69	69,392.69
应付托管费	-	-	-	11,565.46	11,565.46
应付交易费用	-	-	-	13,079.72	13,079.72
应付利息	-	-	-	32,225.12	32,225.12
应交税费	-	-	-	5,716.06	5,716.06
其他负债	-	-	-	39,000.00	39,000.00
负债总计	32,899,766.10	-	-	170,979.05	33,070,745.15
利率敏感度缺口	16,431,970.10	24,214,832.10	16,788,846.10	10,728,911.60	68,164,559.90

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	549,293.75	467,274.94
	市场利率上调 0.25%	-541,596.40	-460,093.24

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例不高于基金资产的 30%；基金持有全部权证的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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	9,070,239.60	13.76	9,188,730.40	13.48
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	9,070,239.60	13.76	9,188,730.40	13.48

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月	上年度末（2018 年 12 月

		30 日)	31 日)
	业绩比较基准中的权益指数 上涨 5%	430,300.43	356,790.75
	业绩比较基准中的权益指数 下降 5%	-430,300.43	-356,790.75

6.4.14 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 2019 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 9,070,239.60 元，属于第二层次的余额为 78,160,162.10 元，无属于第三层次的余额。（2018 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 8,125,666.40 元，属于第二层次的余额为 90,932,522.20 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 2019 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（2018 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	9,070,239.60	10.05
	其中：股票	9,070,239.60	10.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	78,160,162.10	86.58
	其中：债券	78,160,162.10	86.58
	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	1,282,990.24	1.42
8	其他各项资产	1,766,041.87	1.96
9	合计	90,279,433.81	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	7,100.00	0.01
C	制造业	5,703,160.42	8.65
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	377.58	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,299,041.60	1.97
J	金融业	2,060,560.00	3.13
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,070,239.60	13.76

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所有股票投资明细

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	002311	海大集团	54,300	1,677,870.00	2.55
2	601318	中国平安	13,300	1,178,513.00	1.79
3	000333	美的集团	21,200	1,099,432.00	1.67
4	000661	长春高新	2,400	811,200.00	1.23
5	603039	泛微网络	9,400	697,480.00	1.06
6	002563	森马服饰	61,287	677,834.22	1.03
7	600887	伊利股份	20,100	671,541.00	1.02
8	603345	安井食品	6,800	349,520.00	0.53
9	600406	国电南瑞	18,400	342,976.00	0.52
10	600030	中信证券	13,700	326,197.00	0.49
11	601166	兴业银行	16,300	298,127.00	0.45
12	600031	三一重工	21,379	279,637.32	0.42
13	600588	用友网络	9,620	258,585.60	0.39
14	601128	常熟银行	33,200	256,304.00	0.39
15	002422	科伦药业	4,500	133,785.00	0.20
16	600968	海油发展	2,000	7,100.00	0.01
17	600837	海通证券	100	1,419.00	0.00
18	600104	上汽集团	46	1,173.00	0.00
19	000538	云南白药	14	1,167.88	0.00
20	600258	首旅酒店	21	377.58	0.00

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	002311	海大集团	1,485,721.00	2.18

2	002563	森马服饰	1,135,838.38	1.67
3	000333	美的集团	1,114,218.00	1.63
4	300122	智飞生物	751,829.00	1.10
5	600887	伊利股份	638,140.00	0.94
6	603039	泛微网络	622,159.00	0.91
7	603589	口子窖	595,613.00	0.87
8	601211	国泰君安	575,585.00	0.84
9	603707	健友股份	551,728.00	0.81
10	300579	数字认证	489,671.00	0.72
11	600031	三一重工	482,479.14	0.71
12	601318	中国平安	456,213.00	0.67
13	600028	中国石化	444,284.00	0.65
14	600406	国电南瑞	416,200.00	0.61
15	300596	利安隆	415,142.00	0.61
16	000822	山东海化	399,861.00	0.59
17	300498	温氏股份	375,146.00	0.55
18	600570	恒生电子	369,201.08	0.54
19	000661	长春高新	366,351.00	0.54
20	300036	超图软件	364,168.00	0.53

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	600030	中信证券	1,514,636.20	2.22
2	600900	长江电力	1,155,479.00	1.70
3	601098	中南传媒	961,191.00	1.41
4	300498	温氏股份	811,474.00	1.19
5	603707	健友股份	802,807.00	1.18
6	002563	森马服饰	746,886.00	1.10
7	300122	智飞生物	711,028.00	1.04
8	603589	口子窖	618,137.00	0.91
9	002773	康弘药业	590,397.40	0.87
10	300579	数字认证	551,086.00	0.81
11	601166	兴业银行	550,624.00	0.81

12	601688	华泰证券	548,646.00	0.80
13	601211	国泰君安	538,376.00	0.79
14	600028	中国石化	481,974.00	0.71
15	600547	山东黄金	466,827.00	0.68
16	000895	双汇发展	451,726.76	0.66
17	600570	恒生电子	416,438.00	0.61
18	600406	国电南瑞	391,873.00	0.57
19	300036	超图软件	382,488.00	0.56
20	300271	华宇软件	366,851.00	0.54

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	19,208,284.64
卖出股票收入（成交）总额	21,906,227.11

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	14,685,000.00	22.28
	其中：政策性金融债	14,685,000.00	22.28
4	企业债券	35,667,130.00	54.12
5	企业短期融资券	2,008,600.00	3.05
6	中期票据	21,407,400.00	32.48
7	可转债（可交换债）	4,392,032.10	6.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	78,160,162.10	118.59

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	160213	16 国开 13	100,000	9,547,000.00	14.49
2	170215	17 国开 15	50,000	5,138,000.00	7.80
3	101753012	17 陕煤化 MTN001	50,000	5,127,000.00	7.78
4	101800563	18 豫高管 MTN003	50,000	5,108,500.00	7.75
5	143868	18 电投 09	50,000	5,088,000.00	7.72

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

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。

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	10,026.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,756,015.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,766,041.87

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	113013	国君转债	626,217.20	0.95
2	128024	宁行转债	401,700.00	0.61
3	128047	光电转债	331,829.40	0.50
4	110047	山鹰转债	323,657.80	0.49
5	110049	海尔转债	321,254.40	0.49
6	132015	18 中油 EB	157,602.90	0.24
7	113020	桐昆转债	136,643.00	0.21
8	110040	生益转债	133,030.00	0.20
9	132009	17 中油 EB	98,890.00	0.15
10	110046	圆通转债	96,055.90	0.15
11	128045	机电转债	65,856.00	0.10

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 (户)	户均持有的 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 额比例	持有份额	占总份 额比例
349	167,519.08	0.00	0.00%	58,464,159.12	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 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	65,086,508.56
本报告期基金总申购份额	15,922,428.84
减：本报告期基金总赎回份额	22,544,778.28
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	58,464,159.12

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	
中金公司	2	38,106,515.19	93.88%	10,374.47	93.91%	-
方正证券	2	2,485,837.42	6.12%	672.63	6.09%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	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、本报告期内本基金新增租用 6 个交易单元，为国盛证券上海、深圳证券交易所交易单元各一个；华创证券上海、深圳证券交易所交易单元各一个；中信建投上海、深圳证券交易所交易单元各一个。

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
中金公司	39,394,669.77	92.68%	822,000,000.00	87.17%	-	-
方正证券	3,109,300.00	7.32%	121,000,000.00	12.83%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰康金泰回报 3 个月定期开放混	《中国证券报》、《上	2019 年 1 月 14 日

	合型证券投资基金开放申购、赎回及转换业务公告	海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	
2	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加深圳盈信基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站	2019 年 2 月 22 日
3	泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分基金申购费率的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站	2019 年 4 月 1 日
4	泰康资产管理有限责任公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及基金管理人网站	2019 年 6 月 21 日

§ 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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金注册的文件;
- (二) 《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》;
- (三) 《泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金招募说明书》;
- (四) 《泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金托管协议》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《证券日报》）或登录基金管理人互联网网址（<http://www.tkfunds.com.cn>）查阅。

泰康资产管理有限责任公司

2019 年 8 月 24 日