

# 泰康宏泰回报混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 28 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。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 2017 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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.....	12
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.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
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.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰康宏泰回报混合型证券投资基金
基金简称	泰康宏泰回报混合
基金主代码	002767
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月8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	357,675,980.12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	<p>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。</p> <p>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、估值合理的上市公司股票进行投资。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	15%*沪深300指数收益率+80%*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。

### 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	周峰	张燕
	联系电话	010-57691941	0755-83199084
	电子邮箱	zhoufeng1@taikangamc.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4001895522	95555
传真		010-66429136	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	中国证券报、上海证券报、证券时报
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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	22,443,784.34
本期利润	39,703,127.57
加权平均基金份额本期利润	0.0698
本期加权平均净值利润率	6.72%
本期基金份额净值增长率	7.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	20,985,247.15
期末可供分配基金份额利润	0.0587
期末基金资产净值	387,878,643.54
期末基金份额净值	1.0844
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	8.44%

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。

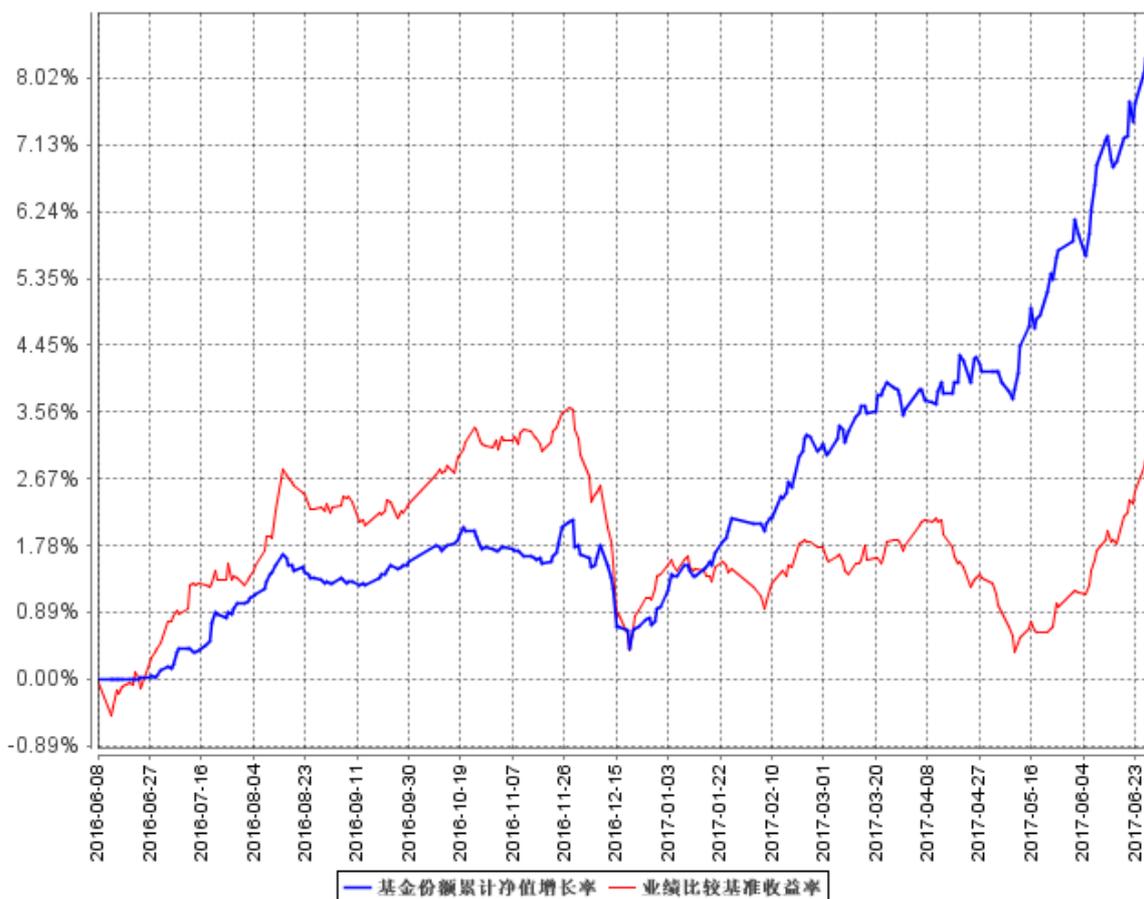
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	2.46%	0.23%	1.73%	0.12%	0.73%	0.11%
过去三个月	4.68%	0.19%	1.09%	0.13%	3.59%	0.06%
过去六个月	7.41%	0.16%	1.49%	0.12%	5.92%	0.04%
过去一年	8.39%	0.13%	2.48%	0.14%	5.91%	-0.01%
自基金合同生效起至今	8.44%	0.13%	2.91%	0.14%	5.53%	-0.01%

### 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 2016 年 6 月 8 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”或“公司”)成立于2006年2月,前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心。截至2015年底,公司注册资本为10亿元,净资产超过56亿元。

截至2016年底,泰康受托资产管理规模破万亿。除管理母公司泰康保险集团股份有限公司委托资产外,泰康资产第三方业务规模突破5000亿元。其中,截至2016年6月30日,泰康资产企业年金投资管理规模突破1200亿元,位居企业年金投资管理人规模第二名。

泰康资产具有丰富的多领域资产配置经验,投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外投资、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、境外理财产品、QDII(合格境内机构投资者)专户、公募基金产品等。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。2016年12月,泰康资产入选基本养老保险基金证券投资管理机构。

截至2017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共15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4月19日	-	5	陈怡,金融学硕士,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、泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。
蒋利娟	本基金基金经理	2016 年 6 月 8 日	-	9	蒋利娟女士，经济学硕士。2008 年 7 月加入泰康资产管理有限责任公司，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，2015 年 6 月 19 日至今担任泰康新意保货币市场基金经理。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。
桂跃强	本基金基金经理	2016 年 6 月 8 日	-	10	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

				<p>型证券投资基金基金经理、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 日至今任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2016 年 11 月 28 日起至今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。2017 年 6 月 15 日起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 日起至今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。</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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 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

2017 年上半年，宏观经济走势平稳中有所复苏，一季度和上半年 GDP 均为 6.9%，较去年有小幅回升。结构上看，受全球经济复苏的影响，出口改善明显；内需上，零售保持平稳，而投资增速则有小幅上行。上半年财政政策积极，货币政策稳健中性，金融监管明显加强。物价方面，CPI 低位平稳，PPI 从高位有所回落，总体通胀压力有所缓和。汇率方面，受到特朗普新政不及预期、欧央行退出宽松的预期升温等因素的影响，美元震荡走弱，人民币保持相对稳定。

债券市场方面，一季度受到美联储加息的影响，中国两次上调公开市场利率，带动收益率震荡上行。进入二季度，受到金融监管加强的影响，叠加货币政策边际趋紧，资金面较为紧张，导致收益率上行；随后监管协调加强，叠加人民币升值，货币政策转为稳健中性，资金面较为平稳，利率在震荡中有所下行。

权益市场方面，上半年 A 股市场整体震荡上行，结构化行情显著，其中以上证 50 为代表的低估值大盘蓝筹股表现较好。具体行业来看，家用电器、食品饮料、钢铁、非银金融、银行等涨幅居前。

报告期内，基金先是维持较低久期，6 月份债市出现阶段性行情时，小幅提高了组合久期。基金挑选利率债以及信用风险可控的中高等级信用债，整体上注重持有期收益，获取相对稳健的投资收益。

权益投资方面，基于对市场的判断，一季度权益仓位保持中性，二季度基金适当提高了权益仓位，主要配置了偏蓝筹价值风格的品种。在行业上，基金重点配置了银行、非银金融、医药生物、食品饮料、家电、房地产等板块。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

泰康宏泰回报混合

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0844，本报告期份额净值增长率为 7.41%，同期业绩比较基准增长率为 1.49%。

#### 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，在外需改善、内需自身动能较强的背景下，经济增长韧性较强。政策方面，预计仍将维持稳健中性的货币政策，监管政策将更加协调有序。从外部环境看，资本外流的压力明显减小，在美元走弱的背景下，人民币汇率料将保持稳定，需关注美联储加息和缩表、欧央行退出 QE 等因素带来的扰动及其影响。

债券市场方面，预计利率水平将受到多方面因素的影响，其中经济基本面的变化、监管动向、海外货币政策等尤其要密切关注。同时潜在的信用风险事件也需要高度重视。本基金未来将继续保持中性久期，注重持有期收益，适当参与利率债的波段操作机会，保持组合灵活性。品种方面，配置以利率债、同业存单及中高等级信用债为主，控制组合信用风险。

权益市场方面，在宏观经济韧性较强、供给侧改革持续推进、金融监管更加协调的大背景下，一方面 A 股的估值体系正在进行国际化重塑，蓝筹股仍有空间；另一方面，大幅调整之后，与估值相匹配的中小市值龙头品种也会有好的投资机会。我们将重点研究低估值的蓝筹龙头、受益于供给侧改革的有提价能力的周期股、被错杀但估值合理的内生成长股，力争为基金持有者取得较好的回报。

#### 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、权益投资部、资产管理部、固定收益投资中心、金融产品投资小组、国际投资部、股权投资部、投后管理部、运营管理部等。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，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，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：泰康宏泰回报混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,195,330.28	407,222.13
结算备付金		426,901.66	939,335.58
存出保证金		61,840.95	60,756.41
交易性金融资产	6.4.7.2	486,941,671.63	479,769,666.60
其中：股票投资		85,760,789.43	78,940,997.10
基金投资		-	-
债券投资		401,180,882.20	400,828,669.50
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	-	49,230,193.85
应收证券清算款		213,774.10	-
应收利息	6.4.7.5	3,951,010.37	7,678,836.77
应收股利		-	-
应收申购款		1,064,574.05	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		493,855,103.04	538,086,011.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		102,831,539.61	11,999,862.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,545,214.22	1,899,205.10
应付管理人报酬		493,468.45	554,706.12
应付托管费		82,244.77	92,451.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	103,365.87	58,709.08
应交税费		706,185.95	91,374.99

应付利息		25,762.08	2,370.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	188,678.55	182,425.83
负债合计		105,976,459.50	14,881,104.54
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	357,675,980.12	518,250,609.53
未分配利润	6.4.7.10	30,202,663.42	4,954,297.27
所有者权益合计		387,878,643.54	523,204,906.80
负债和所有者权益总计		493,855,103.04	538,086,011.34

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0844 元，基金份额总额 357,675,980.12 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰康宏泰回报混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 6 月 8 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		46,148,556.40	838,887.95
1.利息收入		11,964,218.26	653,405.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,260,886.11	265,958.61
债券利息收入		9,098,713.42	69,435.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,604,618.73	318,011.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,646,789.45	24,881.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,561,841.34	24,103.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-7,016,806.30	777.90
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	1,101,754.41	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	17,259,343.23	160,601.56
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	1,278,205.46	-
<b>减：二、费用</b>		6,445,428.83	539,266.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,532,575.50	434,581.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	588,762.63	72,430.27

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	386,849.60	6,160.66
5. 利息支出		1,724,167.57	360.27
其中：卖出回购金融资产支出		1,724,167.57	360.27
6. 其他费用	6.4.7.20	213,073.53	25,733.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		39,703,127.57	299,621.84
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		39,703,127.57	299,621.84

注：本基金合同生效日为 2016 年 6 月 8 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2016 年 6 月 8 日至 2016 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：泰康宏泰回报混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 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（基金净值）	518,250,609.53	4,954,297.27	523,204,906.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,703,127.57	39,703,127.57
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）	-160,574,629.41	-14,454,761.42	-175,029,390.83
其中：1.基金申购款	318,099,581.50	11,917,180.29	330,016,761.79
2.基金赎回款	-478,674,210.91	-26,371,941.71	-505,046,152.62
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）	357,675,980.12	30,202,663.42	387,878,643.54
项目	上年度可比期间 2016 年 6 月 8 日（基金合同生效日）至 2016 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)	602,430,818.84	-	602,430,818.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	299,621.84	299,621.84
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	602,430,818.84	299,621.84	602,730,440.68

注：本基金合同生效日为 2016 年 6 月 8 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2016 年 6 月 8 日至 2016 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

\_\_\_\_\_  
魏宇

\_\_\_\_\_  
李红

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

泰康宏泰回报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 902 号《关于准予泰康宏泰回报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公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康宏泰回报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 602,359,807.54 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(2016)第 670 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 602,430,818.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 71,011.30 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《泰康宏泰回报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核准上市的股票）、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、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、同业存单、通知存款和其他银行存款）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。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%；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%。本基金的业绩比较基准为： $15% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 80% \times \text{中债新综合财富(总值)指数收益率} + 5% \times \text{金融机构人民币活期存款利率(税后)}$ 。

#### 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》、《泰康宏泰回报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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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》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。

(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 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,195,330.28
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	1,195,330.28
-----	--------------

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	72,392,768.64	85,760,789.43	13,368,020.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,283,797.42	4,308,952.20
	银行间市场	396,765,905.91	396,871,930.00
	合计	401,049,703.33	401,180,882.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	473,442,471.97	486,941,671.63	13,499,199.66

#### 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 2017年6月30日
应收活期存款利息	100.74
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	192.10
应收债券利息	3,950,685.08
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4.65
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	27.80

合计	3,951,010.37
----	--------------

#### 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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	77,631.04
银行间市场应付交易费用	25,734.83
合计	103,365.87

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,160.06
预提费用	187,518.49
合计	188,678.55

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	518,250,609.53	518,250,609.53
本期申购	318,099,581.50	318,099,581.50
本期赎回(以“-”号填列)	-478,674,210.91	-478,674,210.91
本期末	357,675,980.12	357,675,980.12

注：申购含红利再投资、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	8,590,900.81	-3,636,603.54	4,954,297.27
本期利润	22,443,784.34	17,259,343.23	39,703,127.57
本期基金份额交易产生的变动数	-10,049,438.00	-4,405,323.42	-14,454,761.42
其中：基金申购款	7,284,519.15	4,632,661.14	11,917,180.29

基金赎回款	-17,333,957.15	-9,037,984.56	-26,371,941.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,985,247.15	9,217,416.27	30,202,663.42

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	2,942.41
定期存款利息收入	1,250,750.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,557.29
其他	3,636.41
合计	1,260,886.11

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	215,557,364.91
减：卖出股票成本总额	193,995,523.57
买卖股票差价收入	21,561,841.34

#### 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 2017年1月1日至2017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	-7,016,806.30
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	-7,016,806.30

##### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,283,597,450.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	1,276,500,257.16

成本总额	
减：应收利息总额	14,113,999.90
买卖债券差价收入	-7,016,806.30

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,101,754.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,101,754.41

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	17,259,343.23
——股票投资	13,265,245.67
——债券投资	3,994,097.56
——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	-
合计	17,259,343.23

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	1,278,023.08

基金转换费收入	182.38
合计	1,278,205.46

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	372,499.60
银行间市场交易费用	14,350.00
合计	386,849.60

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
其他	600.00
债券帐户维护费	18,000.00
银行费用	15,955.04
合计	213,073.53

### 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。

#### 6.4.10 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 2016 年 6 月 8 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 6 月 8 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,532,575.50	434,581.56
其中：支付销售机构的客户维护费	1,613,030.04	277,957.90

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 6 月 8 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	588,762.63	72,430.27

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 2016 年 6 月 8 日（基金合同生效日）至 2016 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。

#### 6.4.10.4 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基金管理人未运用固有资金投资本基金份额。

##### 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年6月8日(基金合同生效日)至2016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	1,195,330.28	2,942.41	2,672,736.50	12,675.27

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 2016 年 6 月 8 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间 2016 年 6 月 8 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日，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（2017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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	网下新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升	2017年	2017	网下新	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-

	股份	6月30日	年7月10日	股流通受限						
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	网下新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	网下新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

## 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
011754103	17 苏国信 SCP010	2017年6月30日	2017年7月3日	新债流通受限	99.97	99.97	100,000	9,996,930.00	9,996,930.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

## 6.4.12.2 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
600643	爱建集团	2017年4月17日	重大事项停牌	14.98	2017年8月2日	16.48	54,095	625,915.21	810,343.10	-

### 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 2017 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 102,831,539.61 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
150201	15 国开 01	2017 年 7 月 3 日	99.99	140,000	13,998,600.00
101663008	16 阳煤股份 MTN001	2017 年 7 月 3 日	100.24	14,000	1,403,360.00
041753017	17 潞安 CP001	2017 年 7 月 3 日	99.94	100,000	9,994,000.00
011772009	17 陕煤化 SCP003	2017 年 7 月 3 日	100.16	200,000	20,032,000.00
111717075	17 光大银行 CD075	2017 年 7 月 3 日	97.79	300,000	29,337,000.00
101751014	17 河钢集 MTN008	2017 年 7 月 3 日	100.31	300,000	30,093,000.00
合计				1,054,000	104,857,960.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

### 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，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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	19,973,000.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	216,118,930.00	186,634,000.00
合计	236,091,930.00	186,634,000.00

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、政策性金融债及央行票据等。

**6.4.13.2 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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	110,530,000.00	31,479,760.40
AAA 以下	20,332,570.00	2,462,745.60
未评级	0.00	0.00
合计	130,862,570.00	33,942,506.00

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、政策性金融债及央行票据等。

**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 2017 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 102,831,539.61 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。

#### 6.4.13.4 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 2017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	1,195,330.28	-	-	-	1,195,330.28
结算备付金	426,901.66	-	-	-	426,901.66
存出保证金	61,840.95	-	-	-	61,840.95
交易性金融资产	280,513,882.20	120,667,000.00	-	85,760,789.43	486,941,671.63
应收证券清算款	-	-	-	213,774.10	213,774.10
应收利息	-	-	-	3,951,010.37	3,951,010.37
应收申购款	-	-	-	1,064,574.05	1,064,574.05
资产总计	282,197,955.09	120,667,000.00	-	90,990,147.95	493,855,103.04
负债					
卖出回购金融资产款	102,831,539.61	-	-	-	102,831,539.61
应付赎回款	-	-	-	1,545,214.22	1,545,214.22
应付管理人报酬	-	-	-	493,468.45	493,468.45
应付托管费	-	-	-	82,244.77	82,244.77
应付交易费用	-	-	-	103,365.87	103,365.87
应付利息	-	-	-	25,762.08	25,762.08
应交税费	-	-	-	706,185.95	706,185.95

其他负债	-	-	-	188,678.55	188,678.55
负债总计	102,831,539.61	-	-	3,144,919.89	105,976,459.50
利率敏感度缺口	179,366,415.48	120,667,000.00	-	87,845,228.06	387,878,643.54
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	407,222.13	-	-	-	407,222.13
结算备付金	939,335.58	-	-	-	939,335.58
存出保证金	60,756.41	-	-	-	60,756.41
交易性金融资产	215,881,163.50	184,947,506.00	-	78,940,997.10	479,769,666.60
买入返售金融资产	49,230,193.85	-	-	-	49,230,193.85
应收利息	-	-	-	7,678,836.77	7,678,836.77
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	266,518,671.47	184,947,506.00	-	86,619,833.87	538,086,011.34
负债					
卖出回购金融资产款	11,999,862.00	-	-	-	11,999,862.00
应付赎回款	-	-	-	1,899,205.10	1,899,205.10
应付管理人报酬	-	-	-	554,706.12	554,706.12
应付托管费	-	-	-	92,451.04	92,451.04
应付交易费用	-	-	-	58,709.08	58,709.08
应付利息	-	-	-	2,370.38	2,370.38
应交税费	-	-	-	91,374.99	91,374.99
其他负债	-	-	-	182,425.83	182,425.83
负债总计	11,999,862.00	-	-	2,881,242.54	14,881,104.54
利率敏感度缺口	254,518,809.47	184,947,506.00	-	83,738,591.33	523,204,906.80

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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	市场利率下调 0.25%	1,060,988.98	864,020.68
	市场利率上调 0.25%	-1,052,906.41	-859,351.97

#### 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%；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不低于基金资产净值的 5%。

##### 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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	85,760,789.43	22.11	78,940,997.10	15.09
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	85,760,789.43	22.11	78,940,997.10	15.09

##### 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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,339,298.78	3,254,452.70
	业绩比较基准下降 5%	-3,339,298.78	-3,254,452.70

#### 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 2017 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 84,900,872.54 元，属于第二层次的余额为 402,040,799.09 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 78,598,837.89 元，属于第二层次的余额为 401,170,828.71 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 2017 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（2016 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	85,760,789.43	17.37
	其中：股票	85,760,789.43	17.37
2	固定收益投资	401,180,882.20	81.23
	其中：债券	401,180,882.20	81.23
	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	1,622,231.94	0.33
7	其他各项资产	5,291,199.47	1.07
8	合计	493,855,103.04	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	-	-
C	制造业	35,845,439.57	9.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	531,056.02	0.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,654,979.84	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	2,256,216.72	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	930,060.00	0.24
J	金融业	30,538,033.54	7.87
K	房地产业	3,883,527.20	1.00
L	租赁和商务服务业	800,203.60	0.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,958,538.54	1.54
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	362,734.40	0.09
S	综合	-	-
	合计	85,760,789.43	22.11

### 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	601398	工商银行	1,670,228	8,768,697.00	2.26
2	601939	建设银行	1,326,504	8,157,999.60	2.10
3	601318	中国平安	161,665	8,020,200.65	2.07
4	000858	五粮液	117,039	6,514,390.74	1.68
5	000069	华侨城A	499,324	5,023,199.44	1.30
6	000333	美的集团	112,917	4,859,947.68	1.25
7	000651	格力电器	102,397	4,215,684.49	1.09
8	601601	中国太保	108,937	3,689,696.19	0.95
9	601607	上海医药	126,568	3,655,283.84	0.94
10	600276	恒瑞医药	56,641	2,865,468.19	0.74
11	600196	复星医药	86,970	2,695,200.30	0.69
12	600622	嘉宝集团	142,272	2,316,188.16	0.60
13	002595	豪迈科技	77,860	1,730,827.80	0.45
14	000402	金融街	133,732	1,567,339.04	0.40
15	603355	莱克电气	23,300	1,369,341.00	0.35
16	603816	顾家家具	22,800	1,340,184.00	0.35
17	600521	华海药业	60,000	1,262,400.00	0.33
18	002415	海康威视	32,685	1,055,725.50	0.27
19	600029	南方航空	115,600	1,005,720.00	0.26
20	601933	永辉超市	141,200	999,696.00	0.26
21	000538	云南白药	9,800	919,730.00	0.24
22	600104	上汽集团	29,400	912,870.00	0.24
23	300258	精锻科技	51,536	850,859.36	0.22
24	600643	爱建集团	54,095	810,343.10	0.21
25	002705	新宝股份	52,660	791,479.80	0.20
26	300033	同花顺	12,000	746,520.00	0.19
27	600887	伊利股份	34,400	742,696.00	0.19

28	601111	中国国航	71,500	697,125.00	0.18
29	600409	三友化工	66,200	666,634.00	0.17
30	300124	汇川技术	25,714	656,735.56	0.17
31	300070	碧水源	34,500	643,425.00	0.17
32	002027	分众传媒	44,900	617,824.00	0.16
33	601688	华泰证券	34,500	617,550.00	0.16
34	603885	吉祥航空	36,454	553,371.72	0.14
35	600900	长江电力	34,529	531,056.02	0.14
36	002475	立讯精密	14,900	435,676.00	0.11
37	600519	贵州茅台	800	377,480.00	0.10
38	600309	万华化学	12,900	369,456.00	0.10
39	601098	中南传媒	19,460	362,734.40	0.09
40	601233	桐昆股份	23,400	324,324.00	0.08
41	002032	苏泊尔	7,900	324,295.00	0.08
42	600030	中信证券	18,600	316,572.00	0.08
43	600054	黄山旅游	17,071	291,914.10	0.08
44	002043	兔宝宝	20,400	282,336.00	0.07
45	002230	科大讯飞	4,600	183,540.00	0.05
46	600138	中青旅	8,660	182,379.60	0.05
47	000776	广发证券	9,100	156,975.00	0.04
48	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
49	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
50	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
51	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
52	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
53	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
54	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
55	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
56	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
57	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
58	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
59	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	601318	中国平安	13,599,916.78	2.60

2	000069	华侨城 A	11,979,139.10	2.29
3	000402	金融街	10,228,294.95	1.95
4	601398	工商银行	9,671,884.29	1.85
5	600622	嘉宝集团	9,066,010.60	1.73
6	601939	建设银行	7,902,028.00	1.51
7	000651	格力电器	6,100,188.98	1.17
8	601601	中国太保	5,905,004.00	1.13
9	601336	新华保险	5,883,656.00	1.12
10	600196	复星医药	5,881,987.00	1.12
11	600690	青岛海尔	5,418,091.00	1.04
12	601288	农业银行	5,309,040.00	1.01
13	601607	上海医药	5,279,373.00	1.01
14	600584	长电科技	4,765,301.00	0.91
15	002595	豪迈科技	4,702,954.00	0.90
16	601628	中国人寿	3,437,072.45	0.66
17	000333	美的集团	3,251,230.68	0.62
18	002242	九阳股份	2,935,364.38	0.56
19	603816	顾家家居	2,694,048.47	0.51
20	002013	中航机电	2,601,000.00	0.50

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	601398	工商银行	11,686,196.86	2.23
2	000069	华侨城 A	9,476,455.95	1.81
3	000402	金融街	9,430,211.00	1.80
4	601318	中国平安	9,357,026.25	1.79
5	000001	平安银行	9,312,150.80	1.78
6	000333	美的集团	9,159,068.33	1.75
7	601939	建设银行	8,387,446.51	1.60
8	601336	新华保险	7,063,985.23	1.35
9	600622	嘉宝集团	6,745,861.90	1.29
10	600690	青岛海尔	6,572,188.27	1.26
11	000858	五粮液	5,773,775.56	1.10

12	600519	贵州茅台	5,680,645.60	1.09
13	601288	农业银行	5,626,712.00	1.08
14	601998	中信银行	5,410,946.00	1.03
15	002013	中航机电	5,124,036.08	0.98
16	601169	北京银行	4,633,732.04	0.89
17	600079	人福医药	4,560,253.00	0.87
18	600208	新湖中宝	4,452,003.44	0.85
19	600584	长电科技	4,328,353.39	0.83
20	600196	复星医药	3,603,088.77	0.69

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	187,550,070.23
卖出股票收入（成交）总额	215,557,364.91

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	4,193,382.20	1.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,033,000.00	7.74
	其中：政策性金融债	30,033,000.00	7.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,019,930.00	15.47
6	中期票据	130,747,000.00	33.71
7	可转债（可交换债）	115,570.00	0.03
8	同业存单	176,072,000.00	45.39
9	其他	-	-
10	合计	401,180,882.20	103.43

### 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

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	111709229	17 浦发银行 CD229	500,000	49,445,000.00	12.75
2	111711229	17 平安银行 CD229	500,000	48,910,000.00	12.61
3	111616203	16 上海银行 CD203	500,000	48,380,000.00	12.47
4	101751014	17 河钢集 MTN008	300,000	30,093,000.00	7.76
5	111717075	17 光大银行 CD075	300,000	29,337,000.00	7.56

### 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	61,840.95
2	应收证券清算款	213,774.10
3	应收股利	-
4	应收利息	3,951,010.37

5	应收申购款	1,064,574.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,291,199.47

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 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
1,539	232,408.04	50,000,000.00	13.98%	307,675,980.12	86.02%

### 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	212,424.24	0.0594%

### 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年6月8日）基金份额总额	602,430,818.84
本报告期期初基金份额总额	518,250,609.53
本报告期基金总申购份额	318,099,581.50
减：本报告期基金总赎回份额	478,674,210.91
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	357,675,980.12

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、本基金托管人、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	
中国国际金融股份有限公司	2	234,849,272.33	58.69%	75,723.21	62.42%	-
光大证券股份有限公司	2	139,430,906.47	34.85%	38,421.19	31.67%	-
东方证券股份有限公司	2	16,432,682.34	4.11%	4,525.12	3.73%	-
兴业证券股份有限公司	2	9,405,197.10	2.35%	2,644.42	2.18%	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	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：①资金雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

（3）本报告期内本基金新增租用 10 个交易单元，分别为光大证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，兴业证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，方正证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，招商证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 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
中国国际金融股份有限公司	3,168,039.94	13.00%	254,300,000.00	79.77%	-	-
光大证券股份有限公司	7,765,278.40	31.87%	42,800,000.00	13.43%	-	-

东方证券股份有限公司	9,757,046.67	40.05%	21,200,000.00	6.65%	-	-
兴业证券股份有限公司	3,674,488.05	15.08%	500,000.00	0.16%	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 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	泰康资产管理有限责任公司关于直销电子交易系统增加北京农商银行卡通联通道快捷支付渠道并实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017年1月9日
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北京肯特瑞财富管理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、证券时报及基金管理人网站	2017年3月14日
3	泰康宏泰回报混合型证券投资基金限制大额申购（含转换转入及定投）业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017年3月17日
4	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上海基煜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、证券时报及基金管理人网站	2017年3月22日
5	关于泰康宏泰回报混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017年4月21日
6	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017年4月22日
7	泰康宏泰回报混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入及定投）业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017年6月3日
8	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增销售机	中国证券报、上海证券报、证券时报及基	2017年6月19日

---

	构并参加其费率优惠活动的公告	金管理人网站	
--	----------------	--------	--

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170316-20170611	-	308,730,342.50	308,730,342.50	-	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时,基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回,投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险,以及当管理人确认大额申购与大额赎回时,可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。</p>							

### 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宏泰回报混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康宏泰回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康宏泰回报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（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）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

2017 年 8 月 28 日