

# 泰康沪港深价值优选灵活配置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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)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.....	7
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
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>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</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.....	58

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泰康沪港深价值优选混合
基金主代码	003580
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 29 日
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	106, 102, 555. 50 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在内地与香港证券市场中优选具备估值优势或成长潜力的公司进行投资，在严控组合风险的基础上力争获取超越业绩比较基准的最大化投资收益。
投资策略	<p>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，力争利用主动式组合管理获得超过业绩比较基准的收益。</p> <p>大类资产配置方面，本基金综合分析宏观经济运行情况、宏观政策、股票市场与债券市场及其他替代资产市场的相对投资价值，在股票与债券等资产类别之间动态配置；根据 A 股、H 股溢价率的变化并综合市场行情，适当调整 A 股与港股的配置比例。</p> <p>股票市场投资方面，本基金主要采取价值型选股策略，综合考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，对股票进行系统化、程序化筛选、排序，在一级、二级市场全面遴选优质估值水平相对合理的国内 A 股及香港股票市场交易互联互通机制下的港股投资标的股票进行重点投资。</p> <p>债券投资和流动性管理方面，本基金动态地确定并调整优先配置的资产类别和比例，综合平衡基金资产在流动性和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。</p>
业绩比较基准	恒生指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*5%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金为跨境证券投资的基金，主要投资于中国大陆 A 股市场和法律法规或监管

	机构允许投资的特定范围内的港股市场。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。
--	---

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周峰	林葛
	联系电话	010-57691941	010-66060069
	电子邮箱	zhoufeng1@taikangamc.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4001895522	95599
传真		010-66429136	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		段国圣	周慕冰

### 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	4,363,787.85
本期利润	10,269,400.13
加权平均基金份额本期利润	0.0596
本期加权平均净值利润率	5.82%
本期基金份额净值增长率	5.76%
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	3,369,940.91
期末可供分配基金份额利润	0.0318
期末基金资产净值	112,088,210.03
期末基金份额净值	1.0564
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	5.64%

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。

(4) 本基金合同生效日为 2016 年 12 月 29 日，截至报告期末不满一年。

#### 3.2 基金净值表现

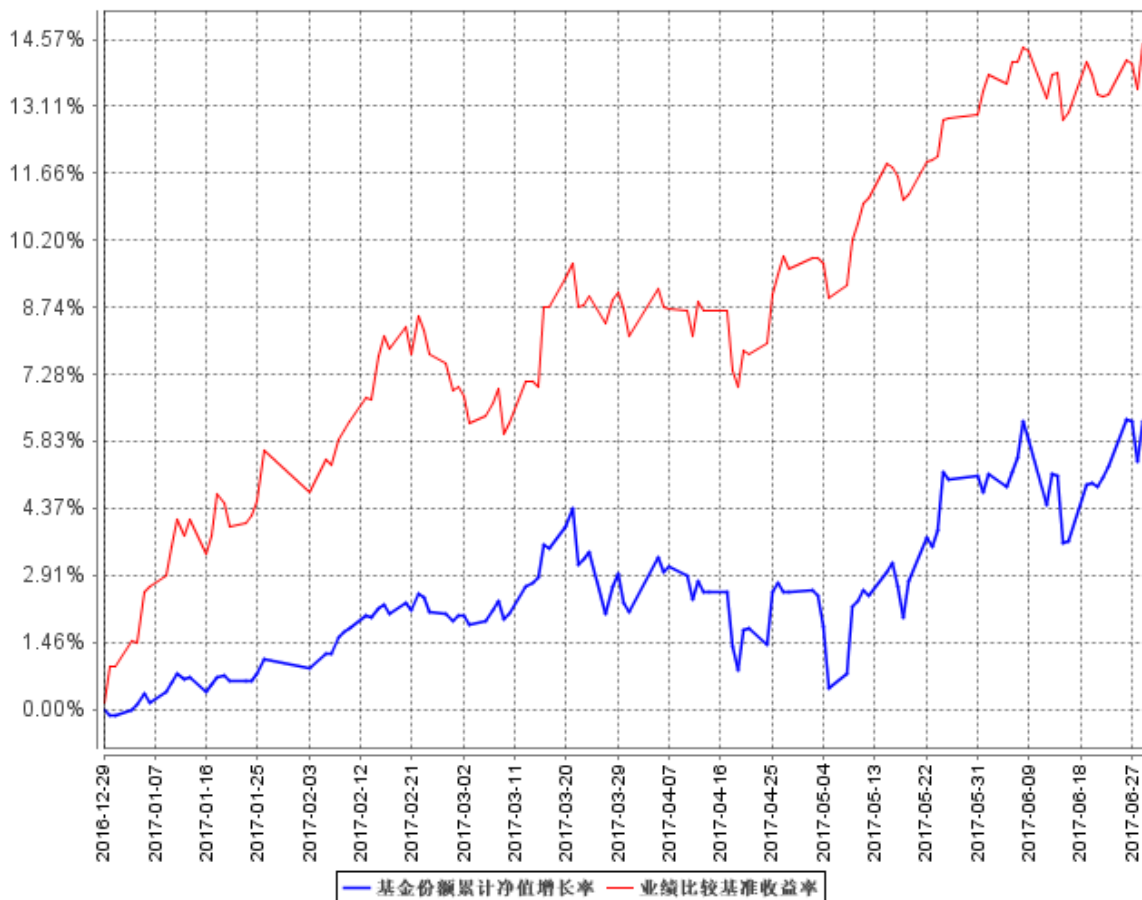
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.53%	0.67%	0.74%	0.50%	-0.21%	0.17%
过去三个月	3.44%	0.63%	5.25%	0.48%	-1.81%	0.15%
过去六个月	5.76%	0.51%	12.73%	0.50%	-6.97%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.64%	0.50%	13.78%	0.50%	-8.14%	0.00%



### 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 12 月 29 日生效，截至报告期末未满一年。

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		
彭一博	本基金基金经理	2016年12月29日	-	8	彭一博于2015年7月加入泰康资产管理有限责任公司,担任公募事业部投资部股票投资总监。曾在华夏基金管理有限公司担任

					<p>行业研究员、基金经理助理，2012年1月12日至2014年5月29日担任兴和证券投资基金基金经理，2014年5月至2015年6月任华夏兴和混合型证券投资基金基金经理。2015年11月2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。2016年3月23日至今任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。2016年6月6日起至今任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年8月24日至今担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2016年12月21日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。2016年12月29日至今担任泰康沪港深价值优选灵活配置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。</p>
刘伟	本基金基金经理	2017年5月4日	-	6	<p>刘伟，理学硕士，于2011年6月加入泰康资产，历任风险控制部风险管理研究员、高级经理、公募事业部投资部金融工程研究员。曾在中国人民健康保险公司从事精算工作。具有丰富的量化研究经验。2017年5月4日至今任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康</p>

					沪港深价值优选灵活配置 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。

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，其中低估值大盘蓝筹股表

现较好。港股市场涨幅显著，其中资讯科技、地产建筑、工业、消费品制造业、金融等行业涨幅居前。

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。

报告期内，本基金跟随市场节奏，在一季度适当提高了权益仓位水平，在二季度保持了略高于基准的仓位，重点配置了金融、资讯科技、消费品制造、电信等行业板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

泰康沪港深价值优选混合

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0564，本报告期份额净值增长率为 5.76%，同期业绩比较基准增长率为 12.73%。

#### 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。

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。

港股市场，展望下半年，我们预计在企业盈利回升、南向资金继续流入、以及海外资金回流等因素的共同影响下，市场将继续保持活跃。尽管由于部分行业估值已明显提升、且南向资金流入在预计 A 股前景向好的背景下或边际上趋弱，从而对 H 股市场的支撑程度可能略有下降，我们认为下半年港股仍有机会，但同时需密切关注经济数据、海外政策不确定等风险点。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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—泰康资产管理有限责任公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，泰康资产管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认为，泰康资产管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：泰康沪港深价值优选灵活配置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	2,123,298.21	11,713,468.23
结算备付金		5,214,141.78	-
存出保证金		21,324.80	-
交易性金融资产	6.4.7.2	96,731,939.68	45,572,760.70
其中：股票投资		90,298,546.88	44,193,556.00
基金投资		-	-
债券投资		6,433,392.80	1,379,204.70
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	15,000,000.00	140,000,000.00
应收证券清算款		-	70,039,953.54
应收利息	6.4.7.5	35,917.27	58,432.41
应收股利		814,127.48	-
应收申购款		118,348.32	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		120,059,097.54	267,384,614.88
<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		-	-
应付证券清算款		3,493,667.88	44,470,318.30
应付赎回款		4,074,617.37	-
应付管理人报酬		152,130.24	18,278.05
应付托管费		20,284.02	2,437.08
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	42,046.86	17,763.42
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	188,141.14	8,100.00
负债合计		7,970,887.51	44,516,896.85
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	106,102,555.50	223,112,505.88
未分配利润	6.4.7.10	5,985,654.53	-244,787.85
所有者权益合计		112,088,210.03	222,867,718.03
负债和所有者权益总计		120,059,097.54	267,384,614.88

注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 29 日，报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0564 元，基金份额总额 106,102,555.50 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰康沪港深价值优选灵活配置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
<b>一、收入</b>		12,452,017.36
1.利息收入		1,342,138.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	64,304.20
债券利息收入		177,836.13
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,099,997.80
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,786,711.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,588,244.41
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	25,865.00
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	1,172,602.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,905,612.28
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	417,555.06
<b>减：二、费用</b>		2,182,617.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,321,979.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	176,263.86

3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	460,442.62
5. 利息支出		13,900.86
其中：卖出回购金融资产支出		13,900.86
6. 其他费用	6.4.7.20	210,030.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>10,269,400.13</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>10,269,400.13</b>

注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 29 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康沪港深价值优选灵活配置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）	223,112,505.88	-244,787.85	222,867,718.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,269,400.13	10,269,400.13
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）	-117,009,950.38	-4,038,957.75	-121,048,908.13
其中：1.基金申购款	10,632,866.13	311,317.50	10,944,183.63
2.基金赎回款	-127,642,816.51	-4,350,275.25	-131,993,091.76
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）	106,102,555.50	5,985,654.53	112,088,210.03

注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 29 日，无上年度可比期间数据。

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

泰康沪港深价值优选灵活配置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 2304 号《关于准予泰康沪港深价值优选灵活配置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《泰康沪港深价值优选灵活配置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 223,046,249.46 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 1673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 223,112,505.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,256.42 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪港深价值优选灵活配置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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、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、分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、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、权证、股指期货、国债期货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(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0%-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%,投资于港股通投资标的股票的比例占基金资产的 0-95%);基金持有全部权证的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,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%;权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:恒生指数收益率\*75%+沪深 300 指数收益率\*5%+中债综合全价指数收益率\*20%。

## 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》、《泰康沪港深价值优选灵活配置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 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为期货投资)等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类

应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具(主要为期货投资)等按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市

场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。

当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

## 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	2,123,298.21
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,123,298.21

### 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	84,615,102.75	90,298,546.88	5,683,444.13
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,423,858.00	9,534.80
	银行间市场	-	-
	合计	6,423,858.00	9,534.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	91,038,960.75	96,731,939.68	5,692,978.93

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券-交易所	15,000,000.00	-
买入返售证券-银行间	-	-
合计	15,000,000.00	-

#### 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	402.03
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	893.77
应收债券利息	38,839.14
应收买入返售证券利息	-4,234.52
应收申购款利息	3.82

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	13.03
合计	35,917.27

#### 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	41,846.86
银行间市场应付交易费用	200.00
合计	42,046.86

#### 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	622.65
预提费用	187,518.49
合计	188,141.14

#### 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	223,112,505.88	223,112,505.88
本期申购	10,632,866.13	10,632,866.13
本期赎回(以“-”号填列)	-127,642,816.51	-127,642,816.51
本期末	106,102,555.50	106,102,555.50

注：申购含红利再投、转换入份额。

#### 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	-32,154.50	-212,633.35	-244,787.85
本期利润	4,363,787.85	5,905,612.28	10,269,400.13
本期基金份额交易	-961,692.44	-3,077,265.31	-4,038,957.75

产生的变动数			
其中：基金申购款	72,174.95	239,142.55	311,317.50
基金赎回款	-1,033,867.39	-3,316,407.86	-4,350,275.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,369,940.91	2,615,713.62	5,985,654.53

#### 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	28,822.19
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	31,652.12
其他	3,829.89
合计	64,304.20

#### 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	115,413,619.47
减：卖出股票成本总额	111,825,375.06
买卖股票差价收入	3,588,244.41

#### 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	25,865.00
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	25,865.00

##### 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	66,182,074.42

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	65,707,169.60
减：应收利息总额	449,039.82
买卖债券差价收入	25,865.00

#### 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	1,172,602.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,172,602.48

#### 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	5,905,612.28
——股票投资	5,897,044.18
——债券投资	8,568.10
——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	5,905,612.28

#### 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	417,555.06
基金转换费收入	-
合计	417,555.06

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将赎回费全额计入基金财产；对持续持有期等于或长于 30 日、少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期等于或长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期等于或长于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。以上每个月按照 30 日计算。未计入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，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	460,017.62
银行间市场交易费用	425.00
合计	460,442.62

#### 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
银行费用	15,911.87
债券帐户维护费	15,000.00
合计	210,030.36

### 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
中国农业银行股份有限公司	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，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
当期发生的基金应支付的管理费	1,321,979.53
其中：支付销售机构的客户维护费	649,959.54

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 1.5% 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 1.5% / 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
当期发生的基金应支付的托管费	176,263.86

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 0.2% / 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，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	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	2,123,298.21	28,822.19

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

**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，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，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**

截至本报告期末2017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证券。

**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
000100	TCL	2017	重	3.43	2017	3.72	28,200	101,957.00	96,726.00	-



	集团	年 4 月 21 日	大 事 项 停 牌		年 7 月 26 日					
002013	中航 机电	2017 年 5 月 12 日	重 大 事 项 停 牌	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	4,350	49,155.00	44,935.50	-
600577	精达 股份	2017 年 6 月 26 日	重 大 事 项 停 牌	4.80	2017 年 7 月 10 日	4.50	6,100	27,867.00	29,280.00	-
600795	国电 电力	2017 年 6 月 5 日	重 大 事 项 停 牌	3.60	-	-	5,000	17,466.00	18,000.00	-

### 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，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 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农业银行，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。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

##### 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	0.0	0.00
A-1 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.2 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	0.0	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 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，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及资产支持证券投资等。

##### 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	2,123,298.21	-	-	-	2,123,298.21
结算备付金	5,214,141.78	-	-	-	5,214,141.78
存出保证金	21,324.80	-	-	-	21,324.80
交易性金融资产	6,433,392.80	-	-	90,298,546.88	96,731,939.68
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	15,000,000.00
应收利息	-	-	-	35,917.27	35,917.27
应收股利	-	-	-	814,127.48	814,127.48
应收申购款	3,976.16	-	-	114,372.16	118,348.32
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	28,796,133.75	-	-	91,262,963.79	120,059,097.54
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,493,667.88	3,493,667.88
应付赎回款	-	-	-	4,074,617.37	4,074,617.37
应付管理人报酬	-	-	-	152,130.24	152,130.24

应付托管费	-	-	-	20,284.02	20,284.02
应付交易费用	-	-	-	42,046.86	42,046.86
其他负债	-	-	-	188,141.14	188,141.14
负债总计	-	-	-	7,970,887.51	7,970,887.51
利率敏感度缺口	28,796,133.75	-	-	83,292,076.28	112,088,210.03
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	11,713,468.23	-	-	-	11,713,468.23
交易性金融资产	1,379,204.70	-	-	44,193,556.00	45,572,760.70
买入返售金融资产	140,000,000.00	-	-	-	140,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	70,039,953.54	70,039,953.54
应收利息	-	-	-	58,432.41	58,432.41
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	153,092,672.93	-	-	114,291,941.95	267,384,614.88
负债					
应付证券清算款	-	-	-	44,470,318.30	44,470,318.30
应付管理人报酬	-	-	-	18,278.05	18,278.05
应付托管费	-	-	-	2,437.08	2,437.08
应付交易费用	-	-	-	17,763.42	17,763.42
其他负债	-	-	-	8,100.00	8,100.00
负债总计	-	-	-	44,516,896.85	44,516,896.85
利率敏感度缺口	153,092,672.93	-	-	69,775,045.10	222,867,718.03

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%	5,808.74	1,171.20
	市场利率上调 0.25%	-5,796.52	-1,169.22

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 84,801,351.84 元，未持有

以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额为 84,801,351.84 元。

假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。若港币相对人民币汇率上升 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 848,013.52 元；若港币相对人民币汇率下降 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-848,013.52 元。

#### 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。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%-95%，投资于港股通投资标的的股票的比例占基金资产等的 0%-95%）；基金持有全部权证的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，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%；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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，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 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	90,298,546.88	80.56	44,193,556.00	19.83
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	90,298,546.88	80.56	44,193,556.00	19.83

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 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 90,109,605.38 元，属于第二层次的余额为 6,622,334.30 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 44,193,556.00 元，属于第二层次的余额为 1,379,204.70 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	90,298,546.88	75.21
	其中：股票	90,298,546.88	75.21
2	固定收益投资	6,433,392.80	5.36
	其中：债券	6,433,392.80	5.36
	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	15,000,000.00	12.49
	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	7,337,439.99	6.11
7	其他各项资产	989,717.87	0.82
8	合计	120,059,097.54	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 84,801,351.84 元，占期末资产净值比例为 75.66%。

### 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	331,704.81	0.30
C	制造业	3,441,801.65	3.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,650.00	0.04
E	建筑业	740,312.25	0.66
F	批发和零售业	49,022.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	157,087.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	329,337.33	0.29
J	金融业	193,542.00	0.17
K	房地产业	103,093.00	0.09
L	租赁和商务服务业	54,252.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	25,550.00	0.02

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	26,843.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	5,497,195.04	4.90

### 7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	2,196,909.41	1.96
B 消费者非必需品	7,765,693.33	6.93
C 消费者常用品	1,985,610.77	1.77
D 能源	4,556,987.44	4.07
E 金融	29,091,681.12	25.95
F 医疗保健	2,052,234.35	1.83
G 工业	6,568,014.09	5.86
H 信息技术	14,719,064.83	13.13
I 电信服务	4,741,351.40	4.23
J 公用事业	3,104,301.49	2.77
K 房地产	8,019,503.61	7.15
合计	84,801,351.84	75.66

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	00700	腾讯控股	32,915	7,975,962.80	7.12
2	00005	汇丰控股	91,469	5,767,120.45	5.15
3	00939	建设银行	692,415	3,635,178.75	3.24
4	02318	中国平安	68,887	3,075,804.55	2.74
5	00941	中国移动	42,244	3,037,766.04	2.71
6	01336	新华保险	85,219	2,936,646.74	2.62
7	02382	舜宇光学科技	34,844	2,116,773.00	1.89
8	01918	融创中国	136,123	1,927,501.68	1.72
9	02628	中国人寿	89,225	1,846,957.50	1.65
10	00883	中国海洋石油	221,477	1,643,359.34	1.47
11	00027	银河娱乐	39,273	1,615,691.22	1.44
12	01398	工商银行	349,000	1,594,930.00	1.42

13	03968	招商银行	74,000	1,512,560.00	1.35
14	00178	莎莎国际	561,500	1,499,205.00	1.34
15	00665	海通国际	350,096	1,400,384.00	1.25
16	00762	中国联通	136,754	1,377,112.78	1.23
17	00388	香港交易所	7,752	1,357,762.80	1.21
18	00081	中国海外宏洋集团	360,145	1,303,724.90	1.16
19	06886	HTSC	95,439	1,242,615.78	1.11
20	00368	中外运航运	677,500	1,158,525.00	1.03
21	03988	中国银行	327,000	1,085,640.00	0.97
22	00020	会德丰	20,595	1,052,816.40	0.94
23	00384	中国燃气	75,613	1,034,385.84	0.92
24	00347	鞍钢股份	204,678	1,033,623.90	0.92
25	01157	中联重科	274,400	905,520.00	0.81
26	000157	中联重科	20,800	93,392.00	0.08
27	06881	中国银河	163,299	992,857.92	0.89
28	00669	创科实业	29,502	919,282.32	0.82
29	00934	中石化冠德	240,000	897,600.00	0.80
30	03323	中国建材	218,704	881,377.12	0.79
31	02282	美高梅中国	56,879	857,166.53	0.76
32	00016	新鸿基地产	8,391	835,324.05	0.75
33	00386	中国石油化工股份	137,257	726,089.53	0.65
34	01177	中国生物制药	119,112	713,480.88	0.64
35	00992	联想集团	162,000	693,360.00	0.62
36	06030	中信证券	49,364	691,589.64	0.62
37	00688	中国海外发展	34,778	689,647.74	0.62
38	00017	新世界发展	79,150	680,690.00	0.61
39	00895	东江环保	62,810	675,835.60	0.60
40	00392	北京控股	19,880	649,678.40	0.58
41	00958	华能新能源	308,207	644,152.63	0.57
42	06808	高鑫零售	114,809	619,968.60	0.55
43	01530	三生制药	68,297	613,990.03	0.55
44	00268	金蝶国际	213,056	600,817.92	0.54
45	02338	潍柴动力	68,135	404,721.90	0.36
46	000338	潍柴动力	8,800	116,160.00	0.10
47	600068	葛洲坝	45,500	511,420.00	0.46

48	00506	中国食品	166,000	476,420.00	0.43
49	00354	中国软件国际	132,423	475,398.57	0.42
50	00857	中国石油股份	111,322	461,986.30	0.41
51	01109	华润置地	23,081	455,849.75	0.41
52	01898	中煤能源	138,278	453,551.84	0.40
53	00267	中信股份	44,124	449,623.56	0.40
54	00175	吉利汽车	30,000	438,600.00	0.39
55	00257	中国光大国际	50,000	422,500.00	0.38
56	03888	金山软件	22,772	402,153.52	0.36
57	00696	中国民航信息网络	20,117	401,535.32	0.36
58	00148	建滔化工	14,500	391,355.00	0.35
59	01766	中国中车	63,000	383,670.00	0.34
60	02883	中海油田服务	68,045	369,484.35	0.33
61	02601	中国太保	13,164	364,511.16	0.33
62	06837	海通证券	32,961	360,922.95	0.32
63	03311	中国建筑国际	31,038	360,040.80	0.32
64	01044	恒安国际	7,117	355,778.83	0.32
65	01776	广发证券	22,724	309,273.64	0.28
66	000776	广发证券	1,700	29,325.00	0.03
67	00763	中兴通讯	20,368	329,554.24	0.29
68	00728	中国电信	101,389	326,472.58	0.29
69	600718	东软集团	19,600	304,780.00	0.27
70	01114	BRILLIANCE CHI	23,944	295,468.96	0.26
71	02313	申洲国际	6,538	291,071.76	0.26
72	00220	统一企业中国	52,760	289,124.80	0.26
73	01099	国药控股	9,379	287,372.56	0.26
74	02007	碧桂园	35,984	282,474.40	0.25
75	00371	北控水务集团	53,546	281,651.96	0.25
76	00914	安徽海螺水泥股份	11,905	280,481.80	0.25
77	02202	万科企业	14,606	280,143.08	0.25

78	02688	新奥能源	6,695	273,691.60	0.24
79	01211	比亚迪股份	6,409	266,422.13	0.24
80	00836	华润电力	20,000	266,000.00	0.24
81	00165	中国光大控股	18,000	265,500.00	0.24
82	03333	中国恒大	21,481	261,423.77	0.23
83	00960	龙湖地产	17,164	249,907.84	0.22
84	01888	建滔积层板	30,500	249,490.00	0.22
85	00576	浙江沪杭甬	28,000	247,800.00	0.22
86	03969	中国通号	46,785	244,217.70	0.22
87	02333	长城汽车	29,053	243,173.61	0.22
88	02319	蒙牛乳业	18,244	242,280.32	0.22
89	03800	保利协鑫能源	325,000	240,500.00	0.21
90	00270	粤海投资	25,719	240,215.46	0.21
91	01800	中国交通建设	27,484	239,935.32	0.21
92	00200	新濠国际发展	13,000	235,820.00	0.21
93	00656	复星国际	22,000	232,980.00	0.21
94	01359	中国信达	92,000	232,760.00	0.21
95	00425	敏实集团	8,000	229,840.00	0.21
96	01093	石药集团	22,992	227,390.88	0.20
97	02238	广汽集团	18,954	225,363.06	0.20
98	03606	福耀玻璃	8,613	223,507.35	0.20
99	01055	中国南方航空股份	39,005	223,498.65	0.20
100	600309	万华化学	7,440	213,081.60	0.19
101	02196	复星医药	8,000	210,000.00	0.19
102	00753	中国国航	30,000	209,700.00	0.19
103	00968	信义光能	108,000	209,520.00	0.19
104	00881	中升控股	16,500	208,560.00	0.19
105	00966	中国太平	11,936	204,941.12	0.18
106	600690	青岛海尔	13,500	203,175.00	0.18
107	00777	网龙	11,500	203,090.00	0.18
108	03958	东方证券	30,040	194,358.80	0.17
109	01169	海尔电器	11,000	193,820.00	0.17
110	01980	天鸽互动	38,372	185,336.76	0.17
111	01193	华润燃气	8,000	185,040.00	0.17
112	00902	华能国际电	38,120	179,164.00	0.16

		力股份			
113	600612	老凤祥	3,600	176,292.00	0.16
114	601668	中国建筑	17,800	172,304.00	0.15
115	600522	中天科技	13,800	166,290.00	0.15
116	600028	中国石化	27,400	162,482.00	0.14
117	002001	新 和 成	8,100	157,221.00	0.14
118	601339	百隆东方	24,200	143,990.00	0.13
119	000528	柳 工	15,800	136,512.00	0.12
120	300269	联建光电	6,700	134,201.00	0.12
121	600761	安徽合力	10,200	133,620.00	0.12
122	601231	环旭电子	8,300	130,393.00	0.12
123	000100	TCL 集团	28,200	96,726.00	0.09
124	601877	正泰电器	4,740	95,226.60	0.08
125	000425	徐工机械	21,600	81,000.00	0.07
126	002519	银河电子	8,500	66,895.00	0.06
127	600741	华域汽车	2,700	65,448.00	0.06
128	600004	白云机场	3,100	57,226.00	0.05
129	600703	三安光电	2,900	57,130.00	0.05
130	601888	中国国旅	1,800	54,252.00	0.05
131	000488	晨鸣纸业	4,200	54,180.00	0.05
132	600089	特变电工	5,203	53,746.99	0.05
133	600999	招商证券	3,100	53,382.00	0.05
134	000090	天健集团	4,800	53,280.00	0.05
135	601168	西部矿业	6,900	53,061.00	0.05
136	600409	三友化工	5,200	52,364.00	0.05
137	601666	平煤股份	9,800	51,646.00	0.05
138	600383	金地集团	4,500	51,615.00	0.05
139	600020	中原高速	10,200	51,408.00	0.05
140	601678	滨化股份	7,300	50,735.00	0.05
141	600183	生益科技	4,000	49,360.00	0.04
142	000761	本钢板材	9,400	49,162.00	0.04
143	600269	赣粤高速	9,300	48,453.00	0.04
144	600475	华光股份	2,400	47,832.00	0.04
145	002233	塔牌集团	3,800	46,246.00	0.04
146	002013	中航机电	4,350	44,935.50	0.04
147	600438	通威股份	7,700	42,966.00	0.04
148	600816	安信信托	2,600	35,334.00	0.03
149	300146	汤臣倍健	2,500	34,350.00	0.03
150	600487	亨通光电	1,200	33,660.00	0.03

151	000858	五粮液	600	33,396.00	0.03
152	000426	兴业矿业	3,600	32,472.00	0.03
153	600060	海信电器	2,100	31,857.00	0.03
154	600271	航天信息	1,500	30,960.00	0.03
155	600668	尖峰集团	1,800	30,924.00	0.03
156	600497	驰宏锌锗	4,700	30,785.00	0.03
157	600498	烽火通信	1,200	30,420.00	0.03
158	600479	千金药业	2,100	30,387.00	0.03
159	600723	首商股份	3,400	30,328.00	0.03
160	600765	中航重机	2,200	30,316.00	0.03
161	002247	帝龙文化	2,300	30,176.00	0.03
162	603766	隆鑫通用	4,100	29,848.00	0.03
163	000876	新希望	3,600	29,592.00	0.03
164	600261	阳光照明	4,500	29,565.00	0.03
165	600577	精达股份	6,100	29,280.00	0.03
166	000055	方大集团	4,000	29,120.00	0.03
167	000625	长安汽车	2,000	28,840.00	0.03
168	601818	光大银行	7,100	28,755.00	0.03
169	601166	兴业银行	1,700	28,662.00	0.03
170	002521	齐峰新材	2,900	28,652.00	0.03
171	600743	华远地产	6,500	27,430.00	0.02
172	002078	太阳纸业	3,700	27,195.00	0.02
173	600551	时代出版	1,700	26,843.00	0.02
174	000539	粤电力A	5,000	26,650.00	0.02
175	300194	福安药业	3,800	26,410.00	0.02
176	002033	丽江旅游	2,500	25,550.00	0.02
177	002493	荣盛石化	2,600	25,376.00	0.02
178	002065	东华软件	1,127	24,557.33	0.02
179	600325	华发股份	2,880	24,048.00	0.02
180	02020	安踏体育	866	19,389.74	0.02
181	600380	健康元	2,100	19,068.00	0.02
182	002419	天虹股份	1,300	18,694.00	0.02
183	600016	民生银行	2,200	18,084.00	0.02
184	600795	国电电力	5,000	18,000.00	0.02
185	002304	洋河股份	200	17,362.00	0.02
186	02328	中国财险	1,405	15,904.60	0.01
187	002376	新北洋	1,000	13,720.00	0.01
188	002152	广电运通	1,458	12,115.98	0.01
189	600887	伊利股份	437	9,434.83	0.01

190	600978	宜华生活	713	7,165.65	0.01
191	01186	中国铁建	277	2,448.68	0.00
192	601186	中国铁建	275	3,308.25	0.00
193	01088	中国神华	326	4,916.08	0.00
194	03328	交通银行	724	3,460.72	0.00
195	01880	百丽国际	619	3,311.65	0.00
196	002092	中泰化学	182	2,311.40	0.00
197	00151	中国旺旺	446	2,038.22	0.00
198	002449	国星光电	122	2,019.10	0.00
199	00390	中国中铁	269	1,436.46	0.00
200	00338	上海石油化工股份	393	1,426.59	0.00
201	601899	紫金矿业	367	1,258.81	0.00
202	03898	中车时代电气	3	99.72	0.00

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。

## 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	00700	腾讯控股	8,051,281.99	3.61
2	00939	建设银行	5,936,198.35	2.66
3	00941	中国移动	5,632,829.55	2.53
4	00005	汇丰控股	3,117,982.18	1.40
5	01336	新华保险	2,974,013.97	1.33
6	02318	中国平安	2,804,599.27	1.26
7	00883	中国海洋石油	2,403,315.77	1.08
8	01398	工商银行	2,335,587.60	1.05
9	02628	中国人寿	2,264,725.33	1.02
10	01766	中国中车	2,006,937.85	0.90
11	06886	HTSC	1,868,771.97	0.84
12	03988	中国银行	1,703,332.17	0.76
13	00762	中国联通	1,594,509.05	0.72
14	00384	中国燃气	1,541,210.13	0.69
15	06030	中信证券	1,503,483.86	0.67
16	00688	中国海外发展	1,483,062.21	0.67



17	00268	金蝶国际	1,470,304.56	0.66
18	02018	瑞声科技	1,444,368.90	0.65
19	02382	舜宇光学科技	1,436,128.16	0.64
20	02328	中国财险	1,432,245.82	0.64

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	00700	腾讯控股	7,460,852.14	3.35
2	00939	建设银行	4,718,541.86	2.12
3	00941	中国移动	4,099,526.40	1.84
4	02018	瑞声科技	2,420,769.94	1.09
5	02628	中国人寿	1,904,692.69	0.85
6	01398	工商银行	1,882,780.54	0.84
7	02318	中国平安	1,829,581.19	0.82
8	00883	中国海洋石油	1,698,716.55	0.76
9	01766	中国中车	1,670,905.83	0.75
10	02328	中国财险	1,578,696.61	0.71
11	06030	中信证券	1,479,442.89	0.66
12	03988	中国银行	1,414,162.68	0.63
13	01099	国药控股	1,388,216.77	0.62
14	01336	新华保险	1,387,444.87	0.62
15	03888	金山软件	1,303,895.83	0.59
16	01776	广发证券	1,250,759.55	0.56
17	06886	HTSC	1,238,991.31	0.56
18	02202	万科企业	1,170,455.17	0.53
19	00688	中国海外发展	1,148,148.02	0.52
20	00762	中国联通	1,145,993.32	0.51

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	152,033,321.76
卖出股票收入（成交）总额	115,413,619.47

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	6,433,392.80	5.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,433,392.80	5.74

## 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	020184	17 贴债 28	49,960	4,915,064.80	4.38
2	019546	16 国债 18	15,200	1,518,328.00	1.35

## 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	21,324.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	814,127.48
4	应收利息	35,917.27
5	应收申购款	118,348.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	989,717.87

### 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
2,531	41,921.20	25,839,680.49	24.35%	80,262,875.01	75.65%

### 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	144,132.67	0.1358%

### 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（2016年12月29日）基金份额总额	223,112,505.88
本报告期期初基金份额总额	223,112,505.88
本报告期基金总申购份额	10,632,866.13
减：本报告期基金总赎回份额	127,642,816.51
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	106,102,555.50

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	
兴业证券	2	64,171,587.07	24.04%	19,488.64	21.06%	-
方正证券	2	202,812,386.65	75.96%	73,050.70	78.94%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	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：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，分别为国泰君安证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，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，中国国际金融股份有限公司上海、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，广发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，东方证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个和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 个为上年度新增。

## 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
兴业证券	14,883,391.60	57.32%	2,441,906,000.00	80.84%	-	-
方正证券	11,080,122.60	42.68%	578,900,000.00	19.16%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

### 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	泰康资产管理有限责任公司关于泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金实施直销电子交易申购（含定期定额投资）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2月23日
3	关于泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金参加部分销售机构申购、定投及转换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2月23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2月23日
5	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、定期定额投资及转换转入业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017年2月23日
6	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金开放日常赎回业务公告	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7日
7	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投资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
8	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
9	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中国工商银行股份有限公司申购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29日
10	泰康沪港深价值优选灵活配置混	中国证券报、上海证	2017年3月29日



	合型证券投资基金 2017 年“清明节”期间暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务公告	券报、证券时报及基金管理人网站	
11	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年“耶稣受难节、复活节”期间暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 4 月 13 日
12	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年“香港佛诞日”期间暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 4 月 28 日
13	关于泰康沪港深价值优选灵活配置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 5 月 6 日
14	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年“端午节”期间暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 5 月 23 日
15	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 6 月 19 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

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沪港深价值优选混合型证券投资基金注册的文件;
- (二) 《泰康沪港深价值优选混合型证券投资基金基金合同》;
- (三) 《泰康沪港深价值优选混合型证券投资基金招募说明书》;
- (四) 《泰康沪港深价值优选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