

泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资 基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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 3 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期为 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰康沪港深精选混合
基金主代码	002653
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 6 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	880,815,043.03 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，精选沪港深股票市场中的优质公司股票，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，本基金在基本面研究的基础上，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，并把控基金资产在流动性和收益性之间的平衡，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	沪深 300 指数收益率*40%+恒生指数收益率*40%+中债新综合财富（总值）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	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年	2017 年	2016 年 6 月 6 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-25,687,263.49	133,026,747.97	21,050,387.29
本期利润	-185,209,892.38	244,831,875.92	16,175,876.46
加权平均基金份额本期利润	-0.1608	0.2456	0.0340
本期基金份额净值增长率	-13.93%	26.36%	6.10%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0270	0.0600	0.0489
期末基金资产净值	918,413,742.01	1,322,540,910.09	787,619,035.85
期末基金份额净值	1.0427	1.2115	1.061

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。

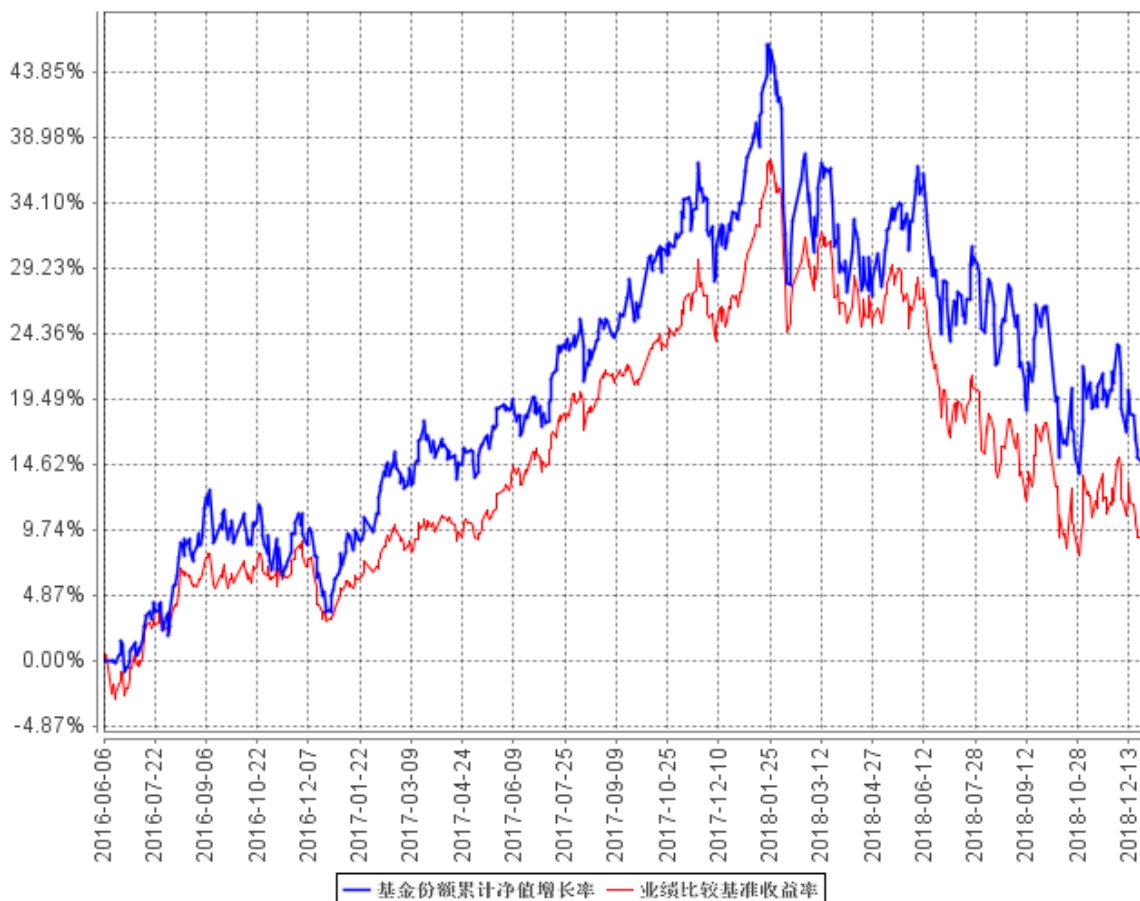
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-8.72%	1.41%	-7.23%	1.21%	-1.49%	0.20%
过去六个月	-10.08%	1.25%	-9.13%	1.05%	-0.95%	0.20%
过去一年	-13.93%	1.25%	-14.30%	0.97%	0.37%	0.28%
自基金合同生效起至今	15.39%	0.97%	9.20%	0.74%	6.19%	0.23%

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

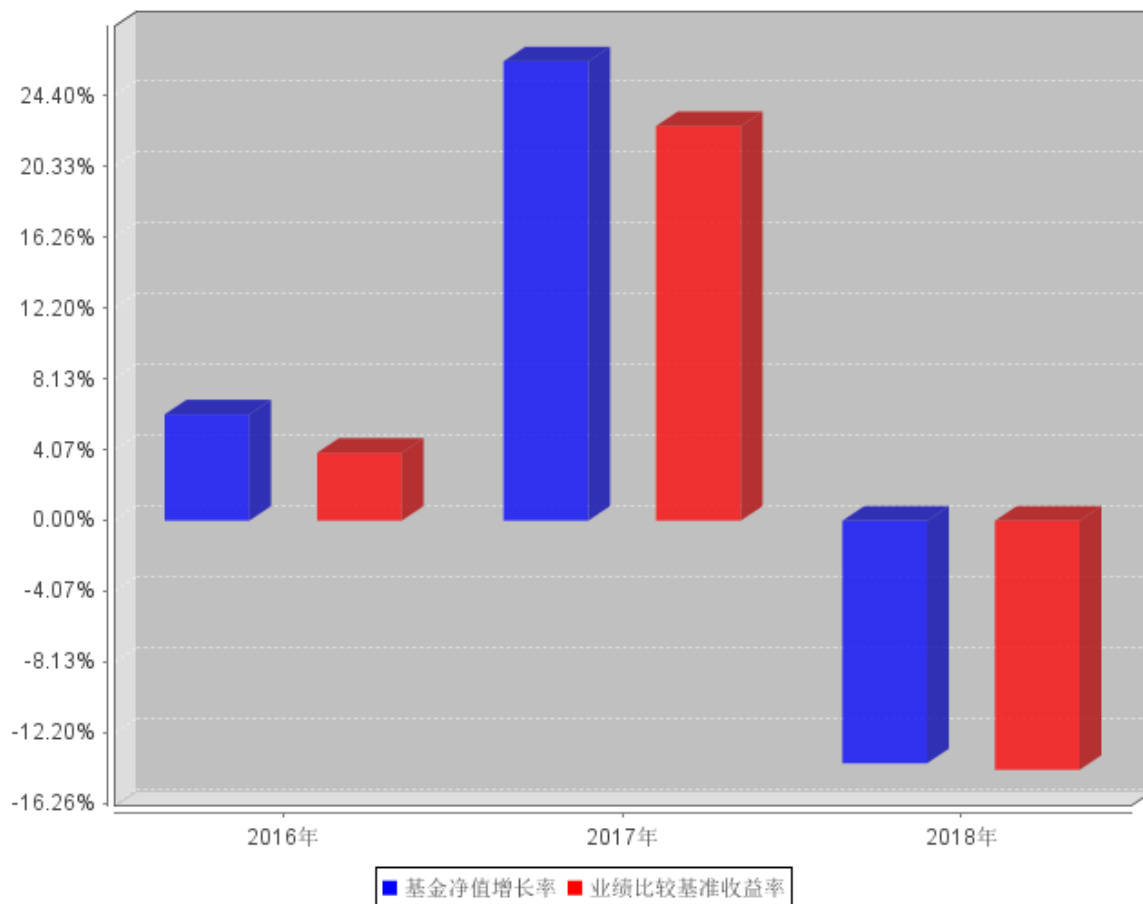


注：1、本基金基金合同于 2016 年 6 月 6 日生效。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于2016年6月6日，2016年度净值增长率的计算期间为2016年6月6日至2016年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	1.2600	72,336,862.67	57,779,307.47	130,116,170.14	
2016	-	-	-	-	
合计	1.2600	72,336,862.67	57,779,307.47	130,116,170.14	

§ 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,前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心。截至2018年12月31日,泰康资产总规模超过14000亿元。除管理泰康委托资产外,泰康资产第三方业务总规模突破7500亿元,另类投资管理规模超过3000亿元,退休金管理规模超过2550亿元。此外,人社部发布的《2018年三季度全国企业年金基金业务数据摘要》显示,泰康资产管理的企业年金基金组合资产金额达2112.61亿元,市场规模排名第一。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、基本养老投资管理、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。截至2018年12月31日,泰康资产公募业务管理规模突破416亿,客户数量超过190万,发行成立泰康薪金保货币市场基金、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和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共二十七只公开募集证券投资基金。

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	说明
----	----	-----------------	-------	----

		任职日期	离任日期	限	
黄成扬	本基金基金经理	2017年11月21日	-	12	黄成扬于2017年7月加入泰康资产管理有限责任公司，现担任公募事业部投资部股票投资总监。2007年7月至2008年12月在金捷基金担任研究部研究员，2009年1月至2012年2月在恒星资产管理公司担任研究部研究员，2012年2月至2017年7月在长盛基金国际业务部历任高级研究员、专户投资经理、基金经理。2015年7月21日至2017年7月14日担任长盛环球景气行业大盘精选证券投资基金基金经理。2017年11月21日至今担任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年12月21日至今担任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基金经理。2019年1月29日至今担任泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金基金经理。
刘伟	本基金基金经理	2017年5月4日	-	8	刘伟于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、基金经理助理。现任公募事业部投资部量化投资总监。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9月29日至今担任泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金经理。2018年2月6日至今担任泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金基金经理。2018年12月21日至今担任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基金经理。2019年1月29日至今担任泰康中证港股通地产指数型发起式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的披露日期。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了公平交易制度和流程，并按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的相关规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公

司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源，保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2018 年，宏观经济平稳运行，边际上小幅走弱，地产和制造业投资、出口全年来看形成支撑，但融资增速下行、消费放缓、外部因素都对经济形成制约。具体来看，投资端受地方政府控隐性债务的影响，基建投资下行，但房地产和制造业投资则有所上行；消费受到居民收入下行、消费意愿边际趋弱的影响，呈现下行的趋势；出口得已于全球经济复苏，表现较好。物价方面，CPI 表现平稳，PPI 冲高后有所回落。社融增速受限于结构性去杠杆而有所下行，汇率在贬值之后趋于稳定。

权益市场方面，受到中美贸易摩擦的影响，同时国内信用紧缩导致的市场不确定性加剧，A 股和 H 股两市场均下行明显。全年来看，上证综指下跌 24.59%，沪深 300 下跌 25.31%，恒生指数下跌 13.61%。其中，港股公用事业、电讯、能源行业涨势较好，能源、消费、原材料等行业跌幅居前。

投资操作层面，上半年，我们更加偏好抗周期或者政府开支相关板块，同时结合中报窗口寻找一些业绩明确改善的板块和个股；三季度时，我们力争在不确定性中寻找相对确定，综合衡量细分板块的成长前景和估值水平，相对看好偏日常消费类、公用事业类、经营状况相对良好的大金融板块，同时关注高油价下的油气板块。并在四季度时加强了对仓位控制，板块配置表现上，我们偏重配置的金融地产板块呈现了一定的抗跌性，同时由于政策的影响，医药板块跌幅较大。我们将积极寻找机会，相机抉择，力求为投资者获得较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康沪港深精选基金份额净值为 1.0427 元,本报告期基金份额净值增长率为 -13.93%; 同期业绩比较基准增长率为-14.30%。

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,基本面下行的压力仍在。地方专项债的放量和提前发行,有望对社融形成支撑,社融增速有望低位企稳,但大幅反弹的难度较大;投资上基建投资有望反弹,与地产投资的潜在下行形成对冲;出口部门受到国际经济下行和贸易战的影响,不确定性较大。政策上,流动性合理充裕的货币政策思路仍将延续,财政政策也正在发力,政策是恪守底线的对冲。

股票市场方面,值得乐观的地方是:经历了 18 年的大幅下跌,目前 A 股和港股的绝对估值水平都到了一个历史的低位,具备相当的防御价值;但国内和海外的宏观经济走势、中美贸易谈判的进展、国内的货币和财政政策的变化、美国特朗普政略的推进等宏观变量,行业的政策和供需变化、公司的治理和业务以及盈利变化等中微观变量,仍复杂而多变,在一定程度上也增强了市场的不确定性。

行业选择层面,我们仍然偏爱基本面更为确定、估值仍在低位的板块,比如大银行、大地产等;成长股方面,至下而上的企业研发和技术进步会是主线,在生物药龙头和互联网龙头仍是我们关注的重点;同时,5G 时代来临催生真正的技术进步给消费电子带来的新的活力,我们会选择具备有真正竞争力的公司合理布局。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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本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 审计报告

本基金 2018 年年度报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	6,779,358.55	11,573,515.05
结算备付金	14,888,433.96	20,457.03
存出保证金	63,914.18	4,026.47
交易性金融资产	890,980,143.09	1,316,356,358.41
其中：股票投资	737,759,099.49	1,116,785,123.41
基金投资	-	-
债券投资	153,221,043.60	199,571,235.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	6,500,000.00	-
应收证券清算款	-	7,012,204.93
应收利息	3,410,141.10	4,900,034.98
应收股利	97,600.84	134,136.86
应收申购款	-	615,647.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	922,719,591.72	1,340,616,380.98
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,500,145.91	15,246,769.48
应付赎回款	-	54,804.59
应付管理人报酬	1,203,226.58	1,787,419.06
应付托管费	160,430.23	238,322.56
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	146,228.83	372,301.00
应交税费	201,818.16	201,797.26
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	94,000.00	174,056.94
负债合计	4,305,849.71	18,075,470.89
所有者权益：		
实收基金	880,815,043.03	1,091,646,548.50
未分配利润	37,598,698.98	230,894,361.59
所有者权益合计	918,413,742.01	1,322,540,910.09
负债和所有者权益总计	922,719,591.72	1,340,616,380.98

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0427 元，基金份额总额 880,815,043.03 份。

7.2 利润表

会计主体：泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-158,757,000.61	274,091,023.69
1. 利息收入	5,571,721.05	8,625,772.67
其中：存款利息收入	372,652.80	379,010.02
债券利息收入	3,416,291.28	7,423,367.00
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,782,776.97	823,395.65
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-5,380,985.29	151,577,528.28
其中：股票投资收益	-35,046,162.16	128,284,256.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	688,256.46	-637,795.98
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	13,374.38
股利收益	28,976,920.41	23,917,693.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-159,522,628.89	111,805,127.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	574,892.52	2,082,594.79
减：二、费用	26,452,891.77	29,259,147.77
1. 管理人报酬	20,141,665.03	17,975,213.75
2. 托管费	2,685,555.30	2,396,695.16
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	3,214,657.72	7,913,665.86
5. 利息支出	10,918.25	506,526.37
其中：卖出回购金融资产支出	10,918.25	506,526.37
6. 税金及附加	50.71	-
7. 其他费用	400,044.76	467,046.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-185,209,892.38	244,831,875.92
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-185,209,892.38	244,831,875.92

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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）	1,091,646,548.50	230,894,361.59	1,322,540,910.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-185,209,892.38	-185,209,892.38
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）	-210,831,505.47	-8,085,770.23	-218,917,275.70
其中：1. 基金申购款	393,819,519.85	81,662,824.85	475,482,344.70
2. 基金赎回款	-604,651,025.32	-89,748,595.08	-694,399,620.40
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）	880,815,043.03	37,598,698.98	918,413,742.01
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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）	742,671,019.82	44,948,016.03	787,619,035.85
二、本期经营活动产生的	-	244,831,875.92	244,831,875.92

基金净值变动数（本期利润）			
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）	348,975,528.68	71,230,639.78	420,206,168.46
其中：1. 基金申购款	1,172,932,926.89	280,818,866.39	1,453,751,793.28
2. 基金赎回款	-823,957,398.21	-209,588,226.61	-1,033,545,624.82
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）	-	-130,116,170.14	-130,116,170.14
五、期末所有者权益（基金净值）	1,091,646,548.50	230,894,361.59	1,322,540,910.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 段国圣 金志刚 李俊佑
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰康沪港深精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 661 号《关于准予泰康沪港深精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《泰康沪港深精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 376,519,240.61 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 574 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 376,540,794.43 份基金份额,其中认购资金利息折合 21,553.82 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《泰康沪港深精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”)、债券等固定收益类金融工具(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、公开发行公司债券、非公开发行公司债券、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、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、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购等)、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款、同业存单和其他银行存款)、货币市场工具、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)。本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%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;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:沪深 300 指数收益率 \times 40%+恒生指数收益率 \times 40%+中债新综合财富(总值)指数收益率 \times 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司于 2019 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 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》、《泰康沪港深精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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[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》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深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[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。

对基金通过沪港通/深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/深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/深港通买卖、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。

(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。

7.4.7 关联方关系

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

7.4.8.1 关联方报酬

7.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,141,665.03	17,975,213.75
其中：支付销售机构的客户维护费	318,486.20	297,272.17

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 1.50%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 1.50% / 当年天数。

7.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,685,555.30	2,396,695.16

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。

7.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2018年1月1日至2018年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	10,287,947.81	-	-	-	-	-

7.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.3.1 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。

7.4.8.3.2 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，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

7.4.8.4 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	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31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	6,779,358.55	176,605.98	11,573,515.05	150,919.19
------	--------------	------------	---------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.5 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。

7.4.8.6 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。

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.12.1.2 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
110049	海尔转债	2018年12月20日	2019年1月18日	网下新债流通受限	100.00	100.00	5,890	589,000.00	589,000.00	-

注：截至本报告期末2018年12月31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。

7.4.9.2 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
600030	中信证券	2018年12月25日	重大事项停牌	16.01	2019年1月10日	17.15	150,000	2,556,718.48	2,401,500.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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。

7.4.10 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 2018 年 12 月 31 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 735,357,599.49 元, 属于第二层次的余额为 155,622,543.60 元, 无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日: 第一层次 1,116,748,226.96 元, 第二层次 199,608,131.45, 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2018 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	737,759,099.49	79.95
	其中：股票	737,759,099.49	79.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	153,221,043.60	16.61
	其中：债券	153,221,043.60	16.61
	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	6,500,000.00	0.70
	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	21,667,792.51	2.35
8	其他各项资产	3,571,656.12	0.39
9	合计	922,719,591.72	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 672,295,441.97 元，占期末资产净值比例为 73.20%。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,884,467.13	1.84
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,033,800.00	0.33
J	金融业	40,144,371.00	4.37
K	房地产业	3,468,022.10	0.38
L	租赁和商务服务业	1,932,997.29	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	-	-
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	65,463,657.52	7.13

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	13,061,603.84	1.42
B 消费者非必需品	39,353,826.75	4.28
C 消费者常用品	26,426,100.98	2.88
D 能源	60,527,569.40	6.59
E 金融	208,025,932.59	22.65
F 医疗保健	28,540,042.35	3.11
G 工业	54,646,280.24	5.95
H 信息技术	88,380,039.45	9.62
I 电信服务	61,343,549.21	6.68
J 公用事业	36,364,086.75	3.96
K 房地产	55,626,410.41	6.06
合计	672,295,441.97	73.20

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	219,277	60,329,681.01	6.57
2	00941	中国移动	691,363	45,643,785.26	4.97
3	02318	中国平安	695,500	42,140,345.00	4.59
4	00939	建设银行	5,526,000	31,277,160.00	3.41
4	601939	建设银行	195,500	1,245,335.00	0.14
5	01398	工商银行	5,763,245	28,239,900.50	3.07
5	601398	工商银行	548,100	2,899,449.00	0.32
6	03988	中国银行	8,168,475	24,178,686.00	2.63
6	601988	中国银行	539,500	1,947,595.00	0.21
7	00883	中国海洋石油	2,049,000	21,719,400.00	2.36
8	01288	农业银行	3,174,000	9,553,740.00	1.04
8	601288	农业银行	978,000	3,520,800.00	0.38
9	00386	中国石化	2,642,000	12,945,800.00	1.41

		工股份			
10	00857	中国石油股份	2,971,449	12,717,801.72	1.38

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。

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	00939	建设银行	38,369,028.22	2.90
2	02018	瑞声科技	37,923,317.75	2.87
3	01398	工商银行	32,907,755.01	2.49
4	00941	中国移动	31,806,660.71	2.40
5	00700	腾讯控股	28,207,155.75	2.13
6	002600	领益智造	25,354,382.00	1.92
7	02318	中国平安	22,754,600.05	1.72
8	002236	大华股份	22,200,656.02	1.68
9	00906	中粮包装	19,145,461.39	1.45
10	01530	三生制药	18,795,855.91	1.42
11	002456	欧菲科技	15,665,246.00	1.18
12	03988	中国银行	15,416,246.87	1.17
13	02319	蒙牛乳业	15,084,656.10	1.14
14	06088	FIT HON TENG	14,991,468.48	1.13
15	01114	BRILLIANCE CHI	13,393,288.69	1.01
16	01177	中国生物制药	12,169,054.43	0.92
17	01336	新华保险	11,977,225.49	0.91
18	600233	圆通速递	10,932,422.35	0.83
19	00883	中国海洋石油	10,849,346.60	0.82
20	02628	中国人寿	10,749,384.98	0.81

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。

8.4.2 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	70,533,771.81	5.33
2	00939	建设银行	58,180,213.83	4.40
3	01398	工商银行	49,275,789.55	3.73
4	00941	中国移动	41,201,375.03	3.12
5	02018	瑞声科技	36,162,195.02	2.73
6	601939	建设银行	32,288,571.07	2.44
7	00005	汇丰控股	30,641,973.53	2.32
8	00388	香港交易所	28,232,032.72	2.13
9	002600	领益智造	19,648,611.39	1.49
10	02318	中国平安	19,318,921.49	1.46
11	03988	中国银行	18,693,851.61	1.41
12	01530	三生制药	17,951,949.82	1.36
13	601318	中国平安	17,276,708.00	1.31
14	01299	友邦保险	16,090,218.81	1.22
15	00386	中国石油化工股份	15,845,329.56	1.20
16	00883	中国海洋石油	15,736,598.59	1.19
17	601398	工商银行	15,123,308.50	1.14
18	02601	中国太保	14,914,526.48	1.13
19	01928	金沙中国有限公司	14,750,812.27	1.12
20	002236	大华股份	14,548,423.58	1.10

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。

8.4.3 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	1,077,019,455.29
卖出股票收入（成交）总额	1,261,318,501.88

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。

8.5 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	80,158,000.00	8.73
	其中：政策性金融债	80,158,000.00	8.73
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）	4,033,043.60	0.44
8	同业存单	69,030,000.00	7.52
9	其他	-	-
10	合计	153,221,043.60	16.68

8.6 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	111820166	18 广发银行 CD166	500,000	49,180,000.00	5.35
2	140418	14 农发 18	300,000	30,153,000.00	3.28
3	160208	16 国开 08	300,000	29,997,000.00	3.27
4	180301	18 进出 01	200,000	20,008,000.00	2.18
5	111815648	18 民生银行 CD648	200,000	19,850,000.00	2.16

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 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。

8.12.3 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	63,914.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	97,600.84
4	应收利息	3,410,141.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,571,656.12

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
4,091	215,305.56	796,120,687.05	90.38%	84,694,355.98	9.62%

9.2 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	604,419.93	0.0686%

9.3 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年6月6日）基金份额总额	376,540,794.43
本报告期期初基金份额总额	1,091,646,548.50
本报告期期间基金总申购份额	393,819,519.85
减:本报告期期间基金总赎回份额	604,651,025.32
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	880,815,043.03

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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未出现重大人事变动。

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

11.5 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，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 85,000.00 元；截至 2018 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 3 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
天风证券	2	633,860,210.64	27.12%	186,151.03	26.51%	-
东吴证券	2	408,990,729.83	17.50%	120,358.87	17.14%	-
兴业证券	2	406,476,910.70	17.39%	120,053.27	17.10%	-
光大证券	2	355,829,947.89	15.22%	103,101.83	14.68%	-

申万宏源	2	197,274,831.25	8.44%	74,002.52	10.54%	-
中金公司	2	126,010,460.88	5.39%	37,803.10	5.38%	-
广发证券	2	99,450,432.00	4.25%	28,897.24	4.12%	-
东方证券	2	86,026,169.42	3.68%	24,851.48	3.54%	-
招商证券	2	12,544,257.96	0.54%	3,612.37	0.51%	-
方正证券	2	10,862,265.49	0.46%	3,258.70	0.46%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	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 2 个交易单元，为海通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

11.7.2 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
天风证券	1,118,063.56	70.24%	4,978,600,000.00	47.15%	-	-
东吴证券	-	-	2,864,200,000.00	27.12%	-	-
兴业证券	473,746.60	29.76%	1,855,500,000.00	17.57%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	789,000,000.00	7.47%	-	-
东方证券	-	-	28,000,000.00	0.27%	-	-
招商证券	-	-	44,000,000.00	0.42%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20180101 - 20181231	326,069,186.56	49,520,468.80	0.00	375,589,655.36	42.64%
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>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无