

泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型
基金中基金（FOF）
2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 31 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根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2020 年 4 月 13 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 本报告期投资基金情况.....	49
7.13 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 本报告持有的基金发生的重大影响事件.....	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.9 其他重大事件.....	59

§11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	泰康睿福 3 月持有混合（FOF）	
基金主代码	008754	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 13 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	342,238,015.32 份	
下属分级基金的基金简称:	泰康睿福 3 月持有混合（FOF）A	泰康睿福 3 月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码:	008754	008755
报告期末下属分级基金的份额总额	288,246,123.01 份	53,991,892.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求多元化的资产配置，通过优选各类型公开募集证券投资基金构建组合，在风险分散的基础上力争获取超越业绩基准的长期稳健收益。
投资策略	<p>本 FOF 将结合基金管理人研发的投资决策体系，定期不定期地调整三类资产的配置比例，对各类资产进行超配和欠配，力争通过基金管理人的主动配置把握各大类资产中长期趋势波动带来的 Beta 收益，获取更优异的风险调整回报。</p> <p>基金投资方面，基金管理人将对全市场的主动型基金和被动型基金进行业绩分析、组合分析、费率比较、流动性比较等，权衡主动型基金和被动型基金的相对优势，在权益类、固收类和商品类的内部确定主动和被动的配置比例，并进行动态调整。基金管理人创立了“以基金经理为核心”的主动型基金研究体系，覆盖全市场各种风格的基金经理和基金产品；被动指数型基金的筛选上，本 FOF 将首先结合基金管理人对市场结构走势的判断，将适合当前市场的、已开发成基金的指数产品筛选出来。力争通过投资优质的主动型基金、跟踪效率较高且流动性较好的被动型基金，获取超越业绩基准的 alpha 收益。</p> <p>股票投资上，本 FOF 在股票基本面研究的基础上，同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，将影响上市公司基本面和股价的增长类因素、估值类因素、盈利类因素、财务风险等因素进行综合分析，精选具有较高投资价值的上市公司，进行股票的选择与组合优化。同时，本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，投资于债券资产。债券投资策略包括：久期管理策略；期限结构配置策略；骑乘策略；息差策略；信用策略；个券精选策略；可转换债券投资策略等。</p>
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率*60%+中证普通债券型基金指数收益率*30%+恒生指数收益率*5%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基

	金中基金。
--	-------

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	贺倩
	联系电话	010-58753683	010-66060069
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4001895522	95599
传真		010-57818785	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	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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

基金级别	泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) A	泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 4 月 13 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 4 月 13 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,465,595.75	387,016.48
本期利润	20,920,976.53	3,775,996.92
加权平均基金份额本期利润	0.0728	0.0723
本期加权平均净值利润率	7.16%	7.11%
本期基金份额净值增长率	7.27%	7.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	2,467,992.54	391,609.36
期末可供分配基金份额利润	0.0086	0.0073
期末基金资产净值	309,195,241.83	57,842,053.44
期末基金份额净值	1.0727	1.0713
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	7.27%	7.13%

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 2020 年 4 月 13 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

泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) A

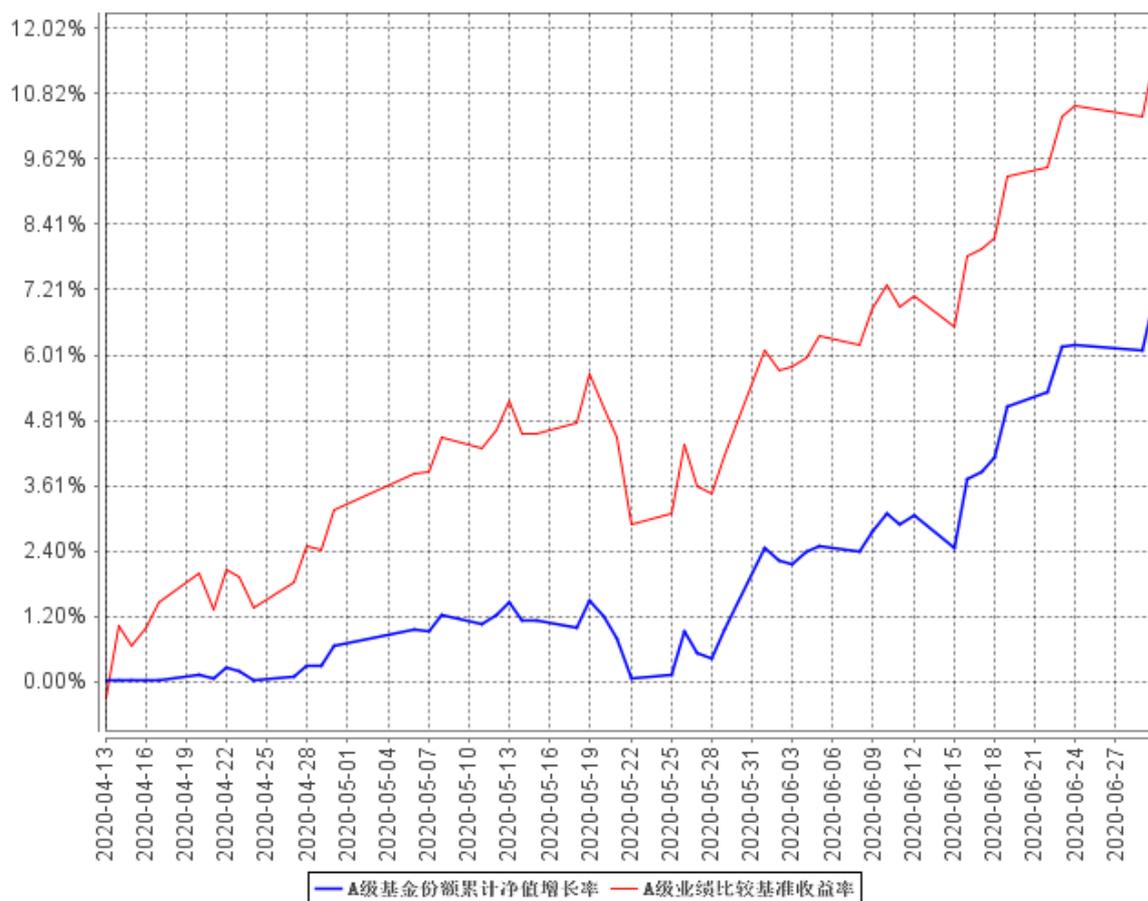
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.25%	0.53%	7.23%	0.61%	-0.98%	-0.08%
自基金合同生效起至今	7.27%	0.42%	11.70%	0.63%	-4.43%	-0.21%

泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) C

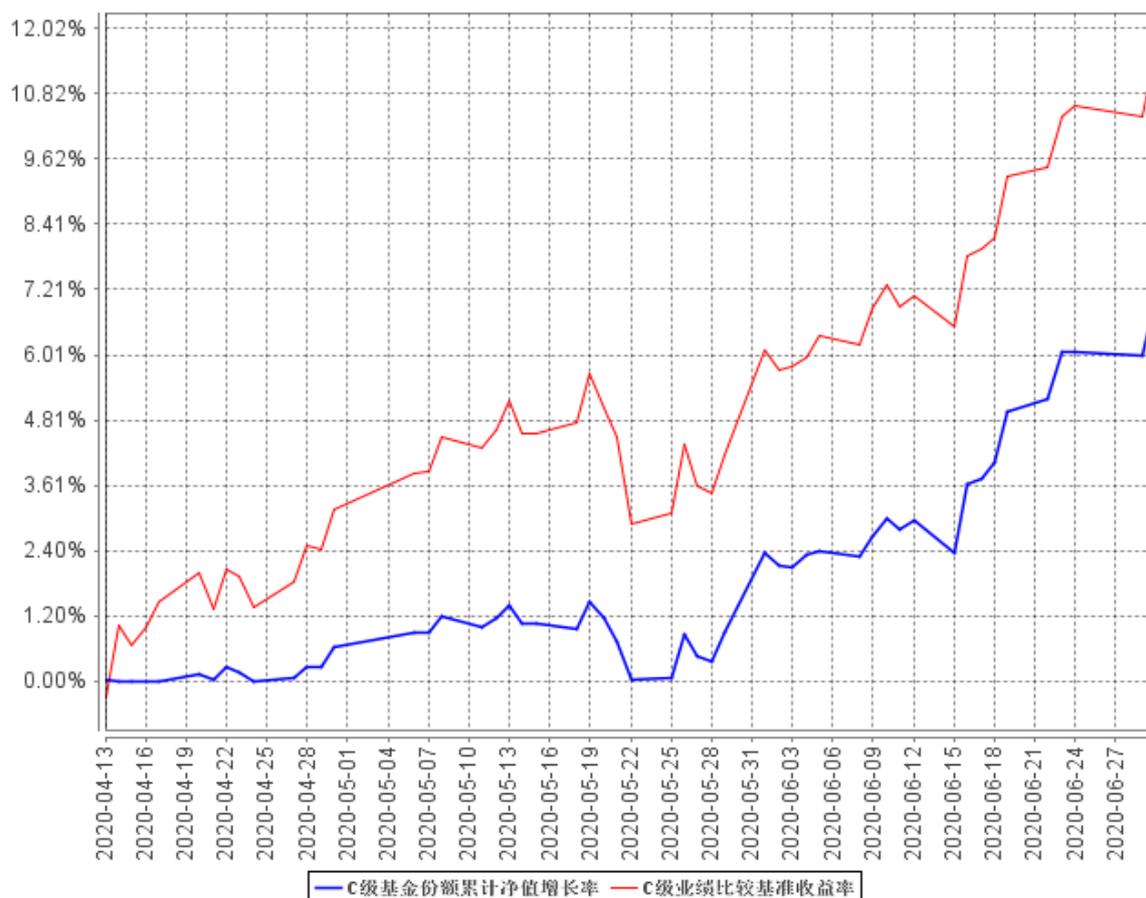
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.20%	0.53%	7.23%	0.61%	-1.03%	-0.08%
自基金合同生效起至今	7.13%	0.42%	11.70%	0.63%	-4.57%	-0.21%

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

A级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



C级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 2020 年 04 月 13 日生效，截止报告期末本基金未满一年。

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，截止报告期末本基金未过建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 2019 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 17000 亿元。除管理泰康委托的资产外，泰康资产管理的第三方业务总规模突破 9000 亿元，另类投资管理规模超过 3900 亿元。目前泰康资产退休金管理规模超过 3800 亿元，其中企业年金管理规模超过 2600 亿元，是国内最大的企业年金投资管理人。

2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。截至 2020 年 6 月 30 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康安业政策性金融债债券型证券投资基金、泰康信用精选债券型证券投资基金、泰康

安欣纯债债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金、泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金、泰康瑞丰纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康长江经济带债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰康申润一年持有期混合型证券投资基金共 45 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		
潘漪	本基金基金经理、公募事业部 FOF 及多资产配置部负责人	2020 年 4 月 13 日	-	14	潘漪于 2018 年 3 月加入泰康资产，现任公募事业部 FOF 及多资产配置部负责人、基金投资执行总监。2006 年至 2008 年在瑞泰人寿保险有限公司担任投资部研究员，2008 年至 2009 年在金元比联基金管理有限公司担任研究部研究员，2009 年至 2011 年在泰康资产管理有限责任公司担任基金投资部研究员，2011 年至 2018 年在阳光资产管理股份有限公司担任基金管理部高级投资经理。2020 年 4 月 13 日至今担任泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执

行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2020 年上半年，疫情席卷全球，对各国的经济和社会产生了重大影响，资本市场也对此作出了剧烈的反应。本基金成立于 4 月中旬，正是金融市场大幅调整的时期，投资者担心疫情的严重性和持续性，以及是否会由此带来全球经济衰退，这些不确定性导致风险偏好急剧下降，从而给睿福提供了较好的建仓机会。

随着中国对疫情的成功管控，主要矛盾逐渐从控制疫情转移到恢复经济，政府相应采取了宽松的货币政策和积极的财政政策。二季度以来，我国的生产和生活均较快地开始恢复，各项经济数据，也印证了复工复产的顺利推进。地产和基建成为经济的重要支撑，消费稳步爬升，出口的超预期则主要来自于防疫物资和中国供应链恢复的领先性。充裕的流动性和恢复中的实体经济，是一种非常有利于权益市场的宏观组合。作为新基金，睿福在首个开放期内需要兼顾绝对收益和相对收益，因此为控制下行风险，睿福采取了均匀建仓的策略，逐步提高权益仓位。

五六月份以来，国内的货币政策体现出了较为克制的态度，重心由宽货币转向宽信用，流动性边际上不再继续宽松，但总体仍然较为充裕。睿福在首个开放日之后，基本将仓位保持在中性水平。

在子基金的选择上，我们秉持两个原则，一是优选具有稳定投资风格和能力圈的品种，和优秀的基金经理共同成长；二是分散配置多元化的投资风格和投资能力，提高组合风险收益比。公募基金行业经过二十年的发展，先后涌现出了不少优秀的基金经理。我们认为的优秀基金经理，应该具备科学的投资理念，较为成熟的投资方法，系统化的研究分析框架，以及丰富的投资实践经验，尤为重要是在能够在逆境中坚守和在实践中进化。作为 FOF 投资者，我们的主要研究对象就是市场上的基金经理，通过对他们的历史投资数据的挖掘和深入的调研，我们积累了一批值得长期投资的基金经理。结合上半年市场较为宽松的流动性环境，我们在睿福建仓过程中优先配置

了偏成长风格的基金经理，并适度配置了少量的价值投资风格，用于平衡组合性价比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康睿福（FOF）A 基金份额净值为 1.0727 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.27%；截至本报告期末泰康睿福（FOF）C 基金份额净值为 1.0713 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.13%；同期业绩比较基准增长率为 11.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

如果说上半年的宏观底色是疫情和宽松，那么展望下半年，我们所处的宏观环境基调是经济的延续复苏以及政策由宽松向灵活稳健过渡。我们预期下半年的经济增速能持续改善，全年能保持低个位数的增长。由于基数原因，经济增速的改善至少能持续到明年一季度。

股市的结构性估值高企是一个无法回避的问题，尤其是在一些确定性较强的品种以及成长空间较大的行业。一方面，由于全球处在低经济增速、低资本回报、低利率的环境，权益品种的估值系统性提升存在一定合理性。但另一方面，也不能忽视，高估值预支了未来几年的盈利增长。并且在高估值背景下，一旦出现基本面不达预期，将面临盈利和估值的双杀。

作为一个平衡偏股的 FOF 产品，在市场未出现明确的风险因素时，睿福将在下半年继续维持中性仓位。但同时我们也时刻警惕高估值本身的风险，我们会把研究的重点放到流动性拐点、基本面变化、估值泡沫化程度、国际环境恶化等可能的风险因素上。

在子基金的选择上，对于高景气高估值的消费医药类资产，我们会更集中投资于注重公司质地和长期竞争力的基金经理；对于下半年仍然可能有正向催化剂的泛科技类资产，我们倾向投资于一些能够优选赛道的成长型基金经理；周期类基金经理在当前公募市场相对较为稀缺，我们也对其中一些品种做好了研究储备，逐步加入睿福组合中。

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 2020 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 托管人对本中期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《公开募集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中期报告中的财务指标、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：泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	31,037,102.78
结算备付金		1,791,364.36
存出保证金		7,270.54
交易性金融资产	6.4.7.2	320,706,750.42
其中：股票投资		-
基金投资		320,706,750.42
债券投资		-
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
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	7,346.93
应收股利		62,687.22
应收申购款		708,357.74
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	29,043.04
资产总计		369,349,923.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,998,021.51
应付赎回款		-
应付管理人报酬		173,388.71
应付托管费		50,508.97
应付销售服务费		27,041.59
应付交易费用	6.4.7.7	12,769.96
应交税费		38,881.91

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	12,015.11
负债合计		2,312,627.76
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	342,238,015.32
未分配利润	6.4.7.10	24,799,279.95
所有者权益合计		367,037,295.27
负债和所有者权益总计		369,349,923.03

注: 报告截止日 2020 年 6 月 30 日, 基金份额总额 342,238,015.32 份, 其中泰康睿福 3 月持有混合 (FOF)A 基金份额净值 1.0727 元, 份额总额 288,246,123.01 份; 泰康睿福 3 月持有混合 (FOF)C 基金份额净值 1.0713 元, 份额总额 53,991,892.31 份。

6.2 利润表

会计主体: 泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期: 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		25,434,786.65
1.利息收入		334,162.50
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	96,602.24
债券利息收入		112,869.36
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		124,690.90
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益 (损失以“-”填列)		3,185,230.02
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益	6.4.7.13	2,181,837.13
债券投资收益	6.4.7.14	-70,092.13
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	1,073,485.02
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	21,844,361.22
4.汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-

5.其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.19	71,032.91
减: 二、费用		737,813.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	427,056.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	131,383.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	68,036.93
4. 交易费用	6.4.7.20	84,317.68
5. 利息支出		3,057.51
其中: 卖出回购金融资产支出		3,057.51
6. 税金及附加		4,556.63
7. 其他费用	6.4.7.21	19,404.08
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		24,696,973.45
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		24,696,973.45

注: 本基金合同生效日为 2020 年 4 月 13 日, 本期是指自基金合同生效日 2020 年 4 月 13 日至 2020 年 6 月 30 日止期间, 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: 泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期: 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 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)	338,528,063.56	-	338,528,063.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	24,696,973.45	24,696,973.45
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)	3,709,951.76	102,306.50	3,812,258.26
其中: 1. 基金申购款	3,709,951.76	102,306.50	3,812,258.26
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)	342,238,015.32	24,799,279.95	367,037,295.27

注:本基金合同生效日为 2020 年 4 月 13 日,本期是指自基金合同生效日 2020 年 4 月 13 日至 2020 年 6 月 30 日止期间,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	_____ 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型证券投资基金中基金(FOF)(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[2019]2707 号《关于准予泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型证券投资基金(FOF)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《泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型证券投资基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的开放式基金,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 338,351,734.15 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字(2020)第 2000353 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型证券投资基金(FOF)基金合同》于 2020 年 4 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 338,528,063.56 份基金份额,其中认购资金利息折合 176,329.41 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《泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型证券投资基金(FOF)招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型证券投资基金(FOF)基金合同》的有关规定,本 FOF 的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国

内经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金份额(不含 QDII 基金、香港互认基金)、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(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、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(包括通知存款、协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具(含同业存单)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本 FOF 的投资组合比例为:投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%;投资于股票型、混合型基金的比例合计为基金资产的 50%-80%;投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;每个交易日日终,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。如法律法规或中国证监会变更上述投资比例限制的,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资比例。本基金的业绩比较基准为:中证偏股型基金指数收益率*60%+中证普通债券型基金指数收益率*30%+恒生指数收益率*5%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%。

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<年度报告和中期报告>》、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》、《泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 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。本期财务报表的实际编制期间为 2020

年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具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以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中以交易性金融负债列示。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

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。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，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。

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、基金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[2017]13 号《中国证监会关于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、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4) 对于基金投资,根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》,采用如下方法估值:

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金,按所投资基金估值日的收盘价估值;

(b) 对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金,按所投资基金估值日的份额净值估值;

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金,如所投资基金披露份额净值,则按所投资基金估值日的份额净值估值;如所投资基金披露万份(百份)收益,则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益;

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况,本基金根据以下原则进行估值:

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的,若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值,按其最近公布的基金份额净值为基础估值;

(b) 以所投资基金的收盘价估值的,若估值日无交易,且最近交易日后市场环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后市场环境发生了重大变化的,可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价,确定公允价值;

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分,基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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。

(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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	31,037,102.78
定期存款	-
其中:存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计:	31,037,102.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	298,862,389.20	320,706,750.42	21,844,361.22
其他	-	-	-
合计	298,862,389.20	320,706,750.42	21,844,361.22

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 2020年6月30日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
交易所市场	15,000,000.00	-
银行间市场	-	-
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 2020年6月30日
应收活期存款利息	6,528.33
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	806.10
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	9.20

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	3.30
合计	7,346.93

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
其他应收款	29,043.04
待摊费用	-
合计	29,043.04

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	12,769.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,769.96

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	12,015.11
合计	12,015.11

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) A	
项目	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日

	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	286,979,217.04	286,979,217.04
本期申购	1,266,905.97	1,266,905.97
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	288,246,123.01	288,246,123.01

金额单位：人民币元

泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) C		
项目	本期 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	51,548,846.52	51,548,846.52
本期申购	2,443,045.79	2,443,045.79
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	53,991,892.31	53,991,892.31

注：1. 申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2020 年 3 月 11 日至 2020 年 4 月 8 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 338,351,734.15 元，其中 A 类基金有效净认购资金为 286,839,462.96 元，C 类基金有效净认购资金为 51,512,271.19 元。根据《泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书》和《泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购 A 类基金资金产生的利息收入 139,754.08 元和认购 C 类基金资金产生的利息收 36,575.33 元在本基金成立后，分别折算为 139,754.08 份 A 类基金份额和 36,575.33 份 C 类基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,465,595.75	18,455,380.78	20,920,976.53

本期基金份额交易产生的变动数	2,396.79	25,745.50	28,142.29
其中：基金申购款	2,396.79	25,745.50	28,142.29
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,467,992.54	18,481,126.28	20,949,118.82

单位：人民币元

泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	387,016.48	3,388,980.44	3,775,996.92
本期基金份额交易产生的变动数	4,592.88	69,571.33	74,164.21
其中：基金申购款	4,592.88	69,571.33	74,164.21
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	391,609.36	3,458,551.77	3,850,161.13

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	87,148.44
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	9,411.35
其他	42.45
合计	96,602.24

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日, 本基金无股票投资收益。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	74,652,013.73
减: 卖出/赎回基金成本总额	72,470,176.60
基金投资收益	2,181,837.13

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位: 人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 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	-70,092.13
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	-70,092.13

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
卖出债券 (、债转股及债券到期兑付) 成交总额	31,908,690.74
减: 卖出债券 (、债转股及债券到期兑付) 成本总额	30,731,305.48
减: 应收利息总额	1,247,477.39
买卖债券差价收入	-70,092.13

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本报告期 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日, 本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本报告期 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日, 本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本报告期 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日, 本基金无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中: 证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,073,485.02
合计	1,073,485.02

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	21,844,361.22
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	21,844,361.22
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	21,844,361.22

6.4.7.19 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	71,032.91
合计	71,032.91

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	14,717.79
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	69,599.89
其中：申购费	18,000.00
赎回费	51,599.89
合计	84,317.68

6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	95,360.83
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	470,010.26
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	85,030.59

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	12,015.11
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	400.00
银行费用	6,988.97
合计	19,404.08

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 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
	2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	427,056.66
其中：支付销售机构的客户维护费	419,403.54

注：1. 本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 1.00% 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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 × 1.00% / 当年天数。

2. 本基金本期因投资于基金管理人所管理的其他基金而已在管理费计算基数中扣除部分对应的管理费金额为 169,473.42 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	131,383.71

注：1. 本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人泰康资产管理有限责任公司的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后余额的 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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 × 0.20% / 当年天数。

2. 本基金本期因投资于基金托管人所托管的其他基金而已在托管费计算基数中扣除部分对应的托管费金额为 11,144.59 元。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) A	泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) C	合计
泰康资产管理有限责任公司	-	28,295.03	28,295.03
农业银行	-	37,198.77	37,198.77
合计	-	65,493.80	65,493.80

注：本基金 A 类基金份额不计提销售服务费，C 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰康资产管理有限责任公司，再由泰康资产管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.60% / 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 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本报告期 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日，本基金未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日，本基金未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期 2020 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日，基金管理人未运用自有资金投资本基金份额。

6.4.10.5.2 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，本基金管理人之外的其他关联方未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.6 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 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	31,037,102.78	87,148.44

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有基金管理人泰康资产管理有限责任公司所管理的公开募集证券投资基金合计 136,003,424.29 元，占本基金资产净值的比例为 37.05%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用 2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费 (元)	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	71,032.91
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	169,473.42
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	11,144.59

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金 (ETF 除外)，应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费 (按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费和当期交易基金产生的赎回费为零。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本

基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.4.11 利润分配情况

本报告期 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日, 本基金无利润分配。

6.4.12 期末(2020 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 2020 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

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止, 本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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 2020 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止, 本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为混合型基金中基金, 其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金, 低于股票型基金和股票型基金中基金。投资本基金可能遇到的风险包括: 证券市场整体环境引发的系统性风险, 个别证券或基金特有的非系统性风险, 大量赎回或暴跌导致的流动性风险, 基金投资过程中产生的操作风险, 因交收违约和投资债券引发的信用风险, 基金投资对象与投资策略引致的特有风险, 等等。

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。

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 2020年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00

未评级	0.00
合计	0.00

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 (计息但该利息金额不重大) 以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值 (所有者权益) 无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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%。本基金与由本

基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	31,037,102.78	-	-	-	31,037,102.78
结算备付金	1,791,364.36	-	-	-	1,791,364.36
存出保证金	7,270.54	-	-	-	7,270.54
交易性金融资产	-	-	-	320,706,750.42	320,706,750.42
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	15,000,000.00
应收利息	-	-	-	7,346.93	7,346.93
应收股利	-	-	-	62,687.22	62,687.22
应收申购款	678,290.82	-	-	30,066.92	708,357.74
其他资产	-	-	-	29,043.04	29,043.04
资产总计	48,514,028.50	-	-	320,835,894.53	369,349,923.03
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,998,021.51	1,998,021.51
应付管理人报酬	-	-	-	173,388.71	173,388.71
应付托管费	-	-	-	50,508.97	50,508.97
应付销售服务费	-	-	-	27,041.59	27,041.59
应付交易费用	-	-	-	12,769.96	12,769.96
应交税费	-	-	-	38,881.91	38,881.91
其他负债	-	-	-	12,015.11	12,015.11
负债总计	-	-	-	2,312,627.76	2,312,627.76
利率敏感度缺口	48,514,028.50	-	-	-318,523,266.77	367,037,295.27

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。

6.4.13.4.2 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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	—	—
交易性金融资产—基金投资	320,706,750.42	87.38
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	320,706,750.42	87.38

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 2020 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 320,706,750.42 元,无属于第二层次和第三层次的余额。

(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 2020 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。

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	320,706,750.42	86.83
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	15,000,000.00	4.06
	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	32,828,467.14	8.89
8	其他各项资产	814,705.47	0.22
9	合计	369,349,923.03	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末投资股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末投资股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本 FOF 将结合基金管理人研发的投资决策体系, 定期不定期地调整三类资产的配置比例, 对各类资产进行超配和欠配, 力争通过基金管理人的主动配置把握各大类资产中长期趋势波动带来的 Beta 收益, 获取更优异的风险调整回报。

基金投资方面, 基金管理人将对全市场的主动型基金和被动型基金进行业绩分析、组合分析、费率比较、流动性比较等, 权衡主动型基金和被动型基金的相对优势, 在权益类、固收类和商品类的内部确定主动和被动的配置比例, 并进行动态调整。基金管理人创立了“以基金经理为核心”的主动型基金研究体系, 覆盖全市场各种风格的基金经理和基金产品; 被动指数型基金的筛选上, 本 FOF 将首先结合基金管理人对市场结构走势的判断, 将适合当前市场的、已开发成基金的指数产品筛选出来。力争通过投资优质的主动型基金、跟踪效率较高且流动性较好的被动型基金, 获取超越业绩基准的 alpha 收益。

股票投资上, 本 FOF 在股票基本面研究的基础上, 同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响, 将影响上市公司基本面和股价的增长类因素、估值类因素、盈利类因素、财务风险等因素进行综合分析, 精选具有较高投资价值的上市公司, 进行股票的选择与组合优化。同时, 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要, 投资于债券资产。债券投资策略包括: 久期管理策略; 期

限结构配置策略；骑乘策略；息差策略；信用策略；个券精选策略；可转换债券投资策略等。

本基金为混合型基金中基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	006865	泰康安惠纯债债券 C	契约型开放式	32,468,780.02	33,575,965.42	9.15	是
2	002246	泰康稳健增利债券 C	契约型开放式	25,259,696.58	33,514,565.42	9.13	是
3	001410	信达澳银新能源产业股票	契约型开放式	8,581,122.21	27,090,602.82	7.38	否
4	005827	易方达蓝筹精选混合	契约型开放式	11,626,001.07	22,876,482.31	6.23	否
5	002529	泰康安益纯债债券 C	契约型开放式	19,135,543.43	22,591,422.57	6.16	是
6	005268	鹏华优势企业股票	契约型开放式	12,317,233.92	22,496,196.03	6.13	否
7	001644	汇丰晋信智造先锋股票 C	契约型开放式	10,199,855.17	18,289,360.31	4.98	否
8	001478	泰康薪金保货币 B	契约型开放式	16,900,000.00	16,900,000.00	4.60	是
9	000006	西部利得量化成长混合	契约型开放式	10,260,618.69	16,457,006.32	4.48	否
10	000294	华安生态优先混合	契约型开放式	3,562,166.01	12,748,992.15	3.47	否
11	004231	中欧行业成长混合	契约型开放式	6,442,053.73	12,248,920.96	3.34	否

		(LOF)C					
12	006408	添富消费升级混合	契约型开放式	6,026,035.08	11,156,601.35	3.04	否
13	470006	汇添富医药保健混合A	契约型开放式	3,998,000.80	10,466,766.09	2.85	否
14	006751	富国互联科技股票	契约型开放式	4,516,872.20	10,395,129.68	2.83	否
15	000251	工银金融地产混合	契约型开放式	4,775,813.15	10,239,343.39	2.79	否
16	005794	银华心怡灵活配置混合	契约型开放式	5,430,107.52	10,237,924.72	2.79	否
17	005475	泰康均衡优选混合C	契约型开放式	7,199,294.24	9,893,270.14	2.70	是
18	005054	泰康瑞坤纯债债券	契约型开放式	8,987,148.38	9,849,015.91	2.68	是
19	003378	泰康策略优选混合	契约型开放式	6,044,539.56	9,607,795.63	2.62	是
20	004861	泰康现金管家货币A	契约型开放式	71,389.20	71,389.20	0.02	是

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.13.3 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	7,270.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	62,687.22
4	应收利息	7,346.93
5	应收申购款	708,357.74
6	其他应收款	29,043.04

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	814,705.47

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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

份额级别	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
泰康睿福 3 月持有混合 (FOF)A	2,582	111,636.76	0.00	0.00%	288,246,123.01	100.00%
泰康睿福 3 月持有混合 (FOF)C	1,421	37,995.70	0.00	0.00%	53,991,892.31	100.00%
合计	3,901	87,730.84	0.00	0.00%	342,238,015.32	100.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	泰康睿福 3 月持有混合 (FOF)A	552,685.18	0.1917%
	泰康睿福 3 月持有混合 (FOF)C	111,098.46	0.2058%
	合计	663,783.64	0.1940%

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	份额级别	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	泰康睿福 3 月持有混合 (FOF)A	0

有本开放式基金	泰康睿福 3 月持有混合 (FOF)C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康睿福 3 月持有混合 (FOF)A	10~50
	泰康睿福 3 月持有混合 (FOF)C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康睿福 3 月持有 混合 (FOF)A	泰康睿福 3 月持有 混合 (FOF)C
基金合同生效日 (2020 年 4 月 13 日) 基金 份额总额	286,979,217.04	51,548,846.52
基金合同生效日起至报告期期末基金总申 购份额	1,266,905.97	2,443,045.79
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分 变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	288,246,123.01	53,991,892.31

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 本报告持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的基金未发生重大影响事件。

10.6 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。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
方正证券	2	-	-	12,769.96	100.00%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-

东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	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

交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

- （1）经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；
- （2）财务状况和经营状况良好；
- （3）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；
- （4）有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；
- （5）能及时提供准确的信息资讯服务；
- （6）满足基金运作的保密要求；
- （7）符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力和服务质量进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行。

3、本报告期内本基金新增租用 30 个交易单元，分别为方正证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、招商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、东吴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、安信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、东兴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、广发证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、中金公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、长江证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、兴业证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、中信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、申万宏源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、天风证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个、国泰

君安证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券	61,272,518.83	100.00%	1,783,500,000.00	100.00%	-	-	41,868,997.70	100.00%
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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	关于泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）开展直销电子交易系统认购费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 2 月 26 日
2	关于泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）新增销售机构并参加部分销售机构认购费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 3 月 11 日
3	泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 4 月 14 日
4	泰康资产管理有限责任公司关于泰康睿福 3 月持有混合（FOF）可投资科创板股票的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 4 月 16 日
5	关于泰康睿福 3 月持有混合（FOF）参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 5 月 6 日
6	泰康睿福 3 月持有混合（FOF）开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 5 月 6 日

7	关于泰康睿福 3 月持有混合 (FOF) 开展直销电子交易系统申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 5 月 6 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参加北京汇成基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 5 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 注册的文件；
- （二）《泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》；
- （三）《泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书》；
- （四）《泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《证券时报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康资产管理有限责任公司

2020 年 8 月 31 日