

# 泰康策略优选灵活配置混合型 证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 1 月 1 日起至 2020 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.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</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.....	60

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泰康策略优选混合
基金主代码	003378
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 28 日
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,002,312,086.85 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	积极主动地配置资产，并通过对类属资产灵活运用多种策略，在合理控制风险的基础上，追求超越业绩比较基准的收益水平，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将利用基金管理人多年来在宏观经济分析上的丰富经验和积累，通过基金管理人自身研发构建的固定收益投资决策分析体系（FIFAM 系统）和权益投资决策分析体系（MVPCT 系统）定期评估宏观经济和投资环境，并对全球及国内经济发展进行评估和展望。在此基础上，判断未来市场投资环境的变化以及市场发展的主要推动因素，预测关键经济变量，并运用泰康资产配置模型，根据股票和债券资产的预期收益和风险，确定大类资产配置比例。</p> <p>股票投资方面，本基金将结合市场环境灵活运用多种投资策略，多维度分析股票的投资价值，充分挖掘市场中潜在的投资机会，实现基金资产的长期稳健增值。债券投资方面，本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期和期限结构配置。另外，本基金将利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评级，分析违约风险以及合理信用利差水平，识别信用债的投资价值。</p>
业绩比较基准	60%*沪深 300 指数收益率+35%*中债新综合财富(总值)指数收益率+5%*金融机构人民币活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康资产管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	郭明
	联系电话	010-58753683	(010) 66105798
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4001895522	95588
传真		010-57818785	(010) 66105799
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		段国圣	陈四清

## 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》
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	84,061,209.02
本期利润	285,909,742.33
加权平均基金份额本期利润	0.2931
本期加权平均净值利润率	21.94%
本期基金份额净值增长率	24.84%
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	251,273,835.66
期末可供分配基金份额利润	0.2507
期末基金资产净值	1,593,202,889.84
期末基金份额净值	1.5895
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	64.67%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

(3) 本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

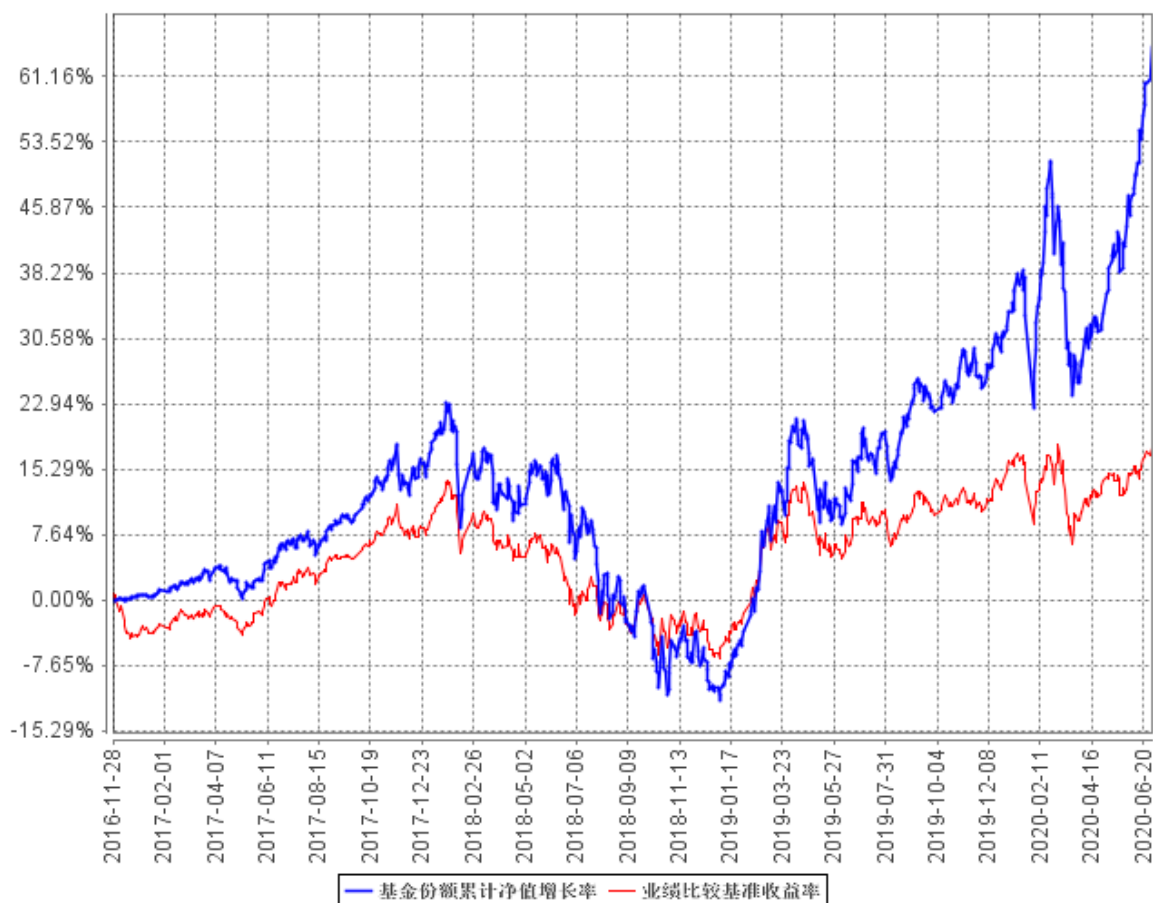
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	14.63%	1.08%	4.31%	0.53%	10.32%	0.55%
过去三个月	30.73%	1.08%	7.57%	0.54%	23.16%	0.54%
过去六个月	24.84%	1.68%	2.17%	0.90%	22.67%	0.78%
过去一年	41.26%	1.29%	7.58%	0.72%	33.68%	0.57%
过去三年	54.51%	1.21%	15.48%	0.75%	39.03%	0.46%
自基金合同生效起至今	64.67%	1.12%	17.75%	0.70%	46.92%	0.42%



### 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



- 1、本基金基金合同于 2016 年 11 月 28 日生效。
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 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		
桂跃强	本基金基金经理、公募事业部权益投资负责人	2016 年 11 月 28 日	-	13	桂跃强于 2015 年 8 月加入泰康资产，现担任公募事业部股票投资负责人。2007 年 9 月至 2015 年 8 月曾任职于新华基金管理有限公司，担任基金管理有限公司副总监。历任新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 8 日至今担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月 8 日至今担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 28 日至今担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 15 日至今担任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 20 日至 2020 年 7 月 2 日担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经

					<p>理。2017 年 12 月 13 日至 2020 年 1 月 10 日担任泰康景泰回报混合型证券投资基金基金经理。2018 年 1 月 19 日至 2020 年 1 月 10 日担任泰康均衡优选混合型证券投资基金基金经理。2018 年 5 月 30 日至今担任泰康颐年混合型证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 13 日至 2020 年 7 月 24 日担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 23 日至今担任泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 20 日至今担任泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
经惠云	本基金基金经理	2017 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 6 日	11	<p>经惠云于 2016 年 10 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固定收益投资总监。2009 年 7 月至 2015 年 6 月在银华基金管理有限公司历任固定收益部研究员，以及银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金（LOF）基金经理，2015 年 6 月至 2016 年 9 月在大成基金管理有限公司担任固定收益总部基金经理，期间曾任大成景华一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 25 日至 2020 年 1 月 6 日担任泰康</p>

					<p>策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 25 日至今担任泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 5 月 15 日至今担任泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 4 日至今担任泰康信用精选债券型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 25 日至今担任泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>2020 年 6 月 8 日至今担任泰康瑞丰纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 24 日至今担任泰康长江经济带债券型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 27 日至今担任泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。</p>
宋仁杰	本基金基金经理	2019 年 9 月 16 日	-	7	<p>宋仁杰于 2018 年 3 月加入泰康资产，现任公募事业部股票投资高级经理。</p> <p>2012 年 7 月至 2016 年 10 月历任华商基金管理有限公司研究员。2016 年 10 月至 2017 年 7 月历任华商基金管理有限公司基金经理助理。2017 年 7 月至 2017 年 11 月历任深圳东方君正资产管理有限公司投资经理。2018 年 7 月 2 日至 2019 年 9 月 15 日担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2019 年 5 月 7 日至 2020 年 1 月 17 日担</p>

					任泰康均衡优选混合型证券投资基金基金经理助理。2019年9月16日至今担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年1月10日至今担任泰康景泰回报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合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2020 年上半年经济受到疫情的影响，呈现了先快速下行、再明显反弹的走势。国内疫情得到明显控制，但还是疫情还在深度发酵，中国的生产能力优势凸显，承担了世界工厂的角色，出口部门表现出较强的韧性；国内复工复产较为顺利，基建和地产支撑经济，消费和制造业表现较弱。通胀方面，CPI 高位回落，PPI 明显下行，随后有所企稳；货币条件方面，在宽货币宽信用政策的支持下，M2 和社融的增速持续上行，汇率总体稳定。

权益市场方面，一季度新冠肺炎对海外经济体的影响超出之前的预期，由于外需的不确定性

以及防控海外病例倒灌的影响，中国经济活动的复苏可能还要等待 1-2 个季度。对股票市场谨慎乐观，虽然短期权益市场的盈利下调风险还需要释放，但中长期而言中国经济相比全球其他经济体依然有韧性，宽松的政策环境也对冲了部分风险偏好的下降。进入二季度，随着新冠肺炎疫情在中国得到了有效的控制，4、5 月份的数据显示中国经济韧性强于预期，中国庞大的消费市场和在全球产业链中不断上升的地位为后续的复苏提供了持续的动力，权益市场也探底回升。从涨跌幅数据和板块上来看，上证综指下跌 1.82%，沪深 300 上涨 2.01%，中小板指上涨 22.00%，创业板指上涨 36.19%。其中，消费、食品饮料、医药、电子等板块表现相对较好，石油石化、金融、煤炭等行业表现不佳。

本报告期内，本基金基于空间和确定性进行组合构建，疫情之前组合以空间特征为主的资产为主，三月开始，在疫情之后随着外部环境确定性下降，组合增加了确定性特征的资产。在行业配置方面，我们依然以内需为主线，以食品饮料、传媒、新能源、医药、轻工等行业为主。同时布局一些虽然受外需影响较大，但中长期比较看好的标的。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康策略优选基金份额净值为 1.5895 元，本报告期基金份额净值增长率为 24.84%；同期业绩比较基准增长率为 2.17%。

#### 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，基本面将延续复苏，斜率有所放缓。基建和地产将延续 2 季度的良好表现，但由于政策对于房地产市场的前瞻性防范，预计走向过热的可能性不高；出口将继续呈现出韧性；消费和服务业在消费场景逐步打开、居民消费意愿逐步提升的背景下，预计存在一定的改善空间，但居民收入形成制约。政策预计延续相机抉择的基调，考虑到当前的基本面环境，政策进一步放松或明显收紧的概率都不大，总体可能较为平稳。

权益市场方面，我们欣喜地看到了优秀的上市公司经受住了疫情的考验，并且在这次非正常“供给侧出清”的过程中进一步巩固了竞争优势。但我们也观察到，受益于全球低利率环境，优质公司的估值大幅扩张并不断创历史新高，A 股结构性分化更加极端。

本基金操作将结合各类市场表现与风险收益比，采取较为灵活的策略应对市场变化，动态调整资产配置，争取为持有人获取更好的投资回报。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金的管理人——泰康资产管理有限责任公司在泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对泰康资产管理有限责任公司编制和披露的泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	73,164,649.70	919,068.45
结算备付金		6,889,719.19	7,026,029.55
存出保证金		622,284.74	121,353.50
交易性金融资产	6.4.7.2	1,496,050,923.18	883,554,656.25
其中：股票投资		1,470,431,081.68	801,409,307.25
基金投资		-	-
债券投资		25,619,841.50	82,145,349.00
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	25,000,000.00	-
应收证券清算款		2,040,429.33	21,376,726.14
应收利息	6.4.7.5	810,344.00	1,395,611.83
应收股利		-	-
应收申购款		6,603,632.59	313,517.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,611,181,982.73	914,706,963.24
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		-	10,400,000.00
应付证券清算款		371,043.55	17,142,664.76
应付赎回款		14,533,177.82	2,457,787.18
应付管理人报酬		1,837,330.25	1,113,911.62
应付托管费		306,221.69	185,651.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	810,273.68	244,390.04
应交税费		4.33	7,491.51

应付利息		-	-197.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	121,041.57	76,928.02
负债合计		17,979,092.89	31,628,627.12
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,002,312,086.85	693,615,052.76
未分配利润	6.4.7.10	590,890,802.99	189,463,283.36
所有者权益合计		1,593,202,889.84	883,078,336.12
负债和所有者权益总计		1,611,181,982.73	914,706,963.24

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5895 元，基金份额总额 1,002,312,086.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		302,450,251.47	195,363,880.08
1.利息收入		1,208,992.99	4,495,812.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	193,103.84	44,194.64
债券利息收入		719,739.25	4,430,322.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		296,149.90	21,295.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		95,894,193.71	24,501,633.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	84,855,687.82	17,009,587.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,071,876.84	2,095,963.74
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	9,966,629.05	5,396,081.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	201,848,533.31	166,022,121.15
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	3,498,531.46	344,312.90
<b>减：二、费用</b>		16,540,509.14	8,159,173.21

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,671,797.32	5,433,696.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,611,966.18	905,616.05
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,125,602.18	656,979.84
5. 利息支出		14,462.06	1,025,692.36
其中：卖出回购金融资产支出		14,462.06	1,025,692.36
6. 税金及附加		177.52	11,586.69
7. 其他费用	6.4.7.20	116,503.88	125,601.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		285,909,742.33	187,204,706.87
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		285,909,742.33	187,204,706.87

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 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）	693,615,052.76	189,463,283.36	883,078,336.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	285,909,742.33	285,909,742.33
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）	308,697,034.09	115,517,777.30	424,214,811.39
其中：1.基金申购款	926,078,053.79	362,720,693.49	1,288,798,747.28
2.基金赎回款	-617,381,019.70	-247,202,916.19	-864,583,935.89
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）	1,002,312,086.85	590,890,802.99	1,593,202,889.84
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		



根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康策略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，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、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”）、权证、股指期货、国债期货、债券（包括但不限于国债、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、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、其他银行存款）、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产比例为 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：60%\*沪深 300 指数收益率+35%\*中债新综合财富（总值）指数收益率+5%\*金融机构人民币活期存款利率（税后）

#### 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》、《泰康策略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。

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 1 月 1 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 1 月 1 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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。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	73,164,649.70
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：	73,164,649.70

##### 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	1,162,430,714.29	1,470,431,081.68	308,000,367.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	25,690,000.00	25,619,841.50
	银行间市场	-	-



	合计	25,690,000.00	25,619,841.50	-70,158.50
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,188,120,714.29	1,496,050,923.18	307,930,208.89

#### 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	25,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	25,000,000.00	-

##### 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	7,586.75
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	3,474.72
应收债券利息	799,002.53
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	280.00
合计	810,344.00

#### 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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	810,273.68
银行间市场应付交易费用	-
合计	810,273.68

#### 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	20,046.03
应付证券出借违约金	-
预提费用	100,995.54
合计	121,041.57

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	693,615,052.76	693,615,052.76
本期申购	926,078,053.79	926,078,053.79
本期赎回(以“-”号填列)	-617,381,019.70	-617,381,019.70
- 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	1,002,312,086.85	1,002,312,086.85

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	89,637,932.11	99,825,351.25	189,463,283.36

本期利润	84,061,209.02	201,848,533.31	285,909,742.33
本期基金份额交易产生的变动数	77,574,694.53	37,943,082.77	115,517,777.30
其中：基金申购款	203,603,087.92	159,117,605.57	362,720,693.49
基金赎回款	-126,028,393.39	-121,174,522.80	-247,202,916.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	251,273,835.66	339,616,967.33	590,890,802.99

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	119,730.04
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	70,074.53
其他	3,299.27
合计	193,103.84

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	2,881,717,143.12
减：卖出股票成本总额	2,796,861,455.30
买卖股票差价收入	84,855,687.82

#### 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 2020年1月1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	1,071,876.84
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	1,071,876.84

**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 2020年1月1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	60,062,732.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	57,677,245.57
减：应收利息总额	1,313,610.54
买卖债券差价收入	1,071,876.84

**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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,966,629.05
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,966,629.05

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	201,848,533.31
——股票投资	202,299,595.24
——债券投资	-451,061.93
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	201,848,533.31

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	3,463,626.23
基金转换费收入	34,905.23
合计	3,498,531.46

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

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

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	5,125,227.18
银行间市场交易费用	375.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	5,125,602.18

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	32,323.20
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	600.00
债券帐户维护费	18,000.00

银行费用	5,908.34
律师费	-
公证费	-
合计	116,503.88

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,671,797.32	5,433,696.41
其中：支付销售机构的客户维护费	2,422,750.54	392,611.78

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,611,966.18	905,616.05

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 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

本报告期及上年度可比期间，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

本报告期及上年度可比期间，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

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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

本报告期末及上年度末，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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	73,164,649.70	119,730.04	1,140,208.01	7,806.09

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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**

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本报告期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本报告期，本基金无利润分配。

**6.4.12 期末（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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	网下新股流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	网下新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	网下新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	网下新股流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪	2020	2020	网下	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-



	科技	年 6 月 23 日	年 7 月 3 日	新股 流通 受限							
300847	中船 汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	网下 新股 流通 受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-	
300845	捷安 高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	网下 新股 流通 受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-	
300843	胜蓝 股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	网下 新股 流通 受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-	
300840	酷特 智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	网下 新股 流通 受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-	
300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	网下 新股 流通 受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-	
300233	金城 医药	2020 年 6 月 19 日	2020 年 12 月 21 日	大宗 交易 新股 流通 受限	27.85	28.21	1,000,000	27,850,000.00	28,210,000.00	-	
300450	先导 智能	2020 年 6 月 1 日	2020 年 12 月 2 日	大宗 交易 新股 流通 受限	40.32	42.07	200,000	8,064,000.00	8,414,000.00	-	
688126	沪硅 产业	2020 年 4 月 13 日	2020 年 10 月 20 日	新股 锁定 期流 通受 限	3.89	26.34	220,528	857,853.92	5,808,707.52	-	
688312	燕麦 科技	2020 年 5 月 29 日	2020 年 12 月 8 日	新股 锁定 期流 通受 限	19.68	41.77	7,390	145,435.20	308,680.30	-	
688090	瑞松	2020	2020	新股	27.55	59.45	3,013	83,008.15	179,122.85	-	

	科技	2020年2月7日	2020年8月17日	锁定期流通受限						
688398	赛特新材	2020年2月3日	2020年8月11日	新股锁定期流通受限	24.12	54.47	3,246	78,293.52	176,809.62	-
688178	万德斯	2020年1月6日	2020年7月14日	新股锁定期流通受限	25.20	39.90	3,704	93,340.80	147,789.60	-

注：1. 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债券。

2. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

#### 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工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由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	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由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	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	365,993.20	361,849.00
AAA 以下	216,348.30	31,571,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	582,341.50	31,932,849.00

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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由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约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上市公司发行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得超过 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	73,164,649.70	-	-	-	73,164,649.70
结算备付金	6,889,719.19	-	-	-	6,889,719.19
存出保证金	622,284.74	-	-	-	622,284.74
交易性金融资产	25,037,500.00	-	582,341.50	1,470,431,081.68	1,496,050,923.18
买入返售金融资产	25,000,000.00	-	-	-	25,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	2,040,429.33	2,040,429.33
应收利息	-	-	-	810,344.00	810,344.00
应收申购款	307,355.94	-	-	6,296,276.65	6,603,632.59
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	131,021,509.57	-	582,341.50	1,479,578,131.66	1,611,181,982.73
负债					
应付证券清算款	-	-	-	371,043.55	371,043.55
应付赎回款	-	-	-	14,533,177.82	14,533,177.82
应付管理人报酬	-	-	-	1,837,330.25	1,837,330.25

应付托管费	-	-	-	306,221.69	306,221.69
应付交易费用	-	-	-	810,273.68	810,273.68
应交税费	-	-	-	4.33	4.33
其他负债	-	-	-	121,041.57	121,041.57
负债总计	-	-	-	17,979,092.89	17,979,092.89
利率敏感度缺口	131,021,509.57	-582,341.50	1,461,599,038.77	1,593,202,889.84	
上年度末 2019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	919,068.45	-	-	-	919,068.45
结算备付金	7,026,029.55	-	-	-	7,026,029.55
存出保证金	121,353.50	-	-	-	121,353.50
交易性金融资产	50,212,500.00	30,989,000.00	943,849.00	801,409,307.25	883,554,656.25
应收证券清算款	-	-	-	21,376,726.14	21,376,726.14
应收利息	-	-	-	1,395,611.83	1,395,611.83
应收申购款	3,976.15	-	-	309,541.37	313,517.52
资产总计	58,282,927.65	30,989,000.00	943,849.00	824,491,186.59	914,706,963.24
负债					
卖出回购金融资产款	10,400,000.00	-	-	-	10,400,000.00
应付证券清算款	-	-	-	17,142,664.76	17,142,664.76
应付赎回款	-	-	-	2,457,787.18	2,457,787.18
应付管理人报酬	-	-	-	1,113,911.62	1,113,911.62
应付托管费	-	-	-	185,651.94	185,651.94
应付交易费用	-	-	-	244,390.04	244,390.04
应付利息	-	-	-	-197.95	-197.95
应交税费	-	-	-	7,491.51	7,491.51
其他负债	-	-	-	76,928.02	76,928.02
负债总计	10,400,000.00	-	-	21,228,627.12	31,628,627.12
利率敏感度缺口	47,882,927.65	30,989,000.00	943,849.00	803,262,559.47	883,078,336.12

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下调0.25%	13,206.14	187,795.88
	市场利率上调0.25%	-13,082.45	-186,706.62



#### 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 2020 年 06 月 30 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 10,640,405.59 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 10,640,405.59 元（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 12,081,876.09 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 12,081,876.09 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。若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 106,404.06 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-106,404.06 元（于 2019 年 12 月 31 日，若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 120,818.76 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-120,818.76 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。本基金投资组合中股票资产占基金资产比例为 0%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；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。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		上年度末 2019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	1,470,431,081.68	92.29	801,409,307.25	90.75
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	1,470,431,081.68	92.29	801,409,307.25	90.75

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准中的权益指数 上涨5%	84,735,671.08	40,967,640.61
业绩比较基准中的权益指数 下降5%	-84,735,671.08	-40,967,640.61	

## 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 1,427,141,942.28 元，属于第二层次的余额为 68,908,980.90 元，无属于第三层次的余额。(2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 774,197,448.03 元，属于第二层次的余额为 109,357,208.22 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 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。(2019 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	1,470,431,081.68	91.26
	其中：股票	1,470,431,081.68	91.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,619,841.50	1.59
	其中：债券	25,619,841.50	1.59
	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	25,000,000.00	1.55
	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	80,054,368.89	4.97
8	其他各项资产	10,076,690.66	0.63
9	合计	1,611,181,982.73	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 10,640,405.59 元，占期末资产净值比例为 0.67%

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,118,958,939.45	70.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	78,543,580.44	4.93
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	123,897,840.27	7.78
J	金融业	29,477,130.30	1.85
K	房地产业	31,950,373.06	2.01
L	租赁和商务服务业	66,840,000.00	4.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	713,789.60	0.04

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,396,256.65	0.59
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,459,790,676.09	91.63

### 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（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	4,208,145.00	0.26
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	6,432,260.59	0.40
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	10,640,405.59	0.67

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	000799	酒鬼酒	1,300,000	99,463,000.00	6.24
2	002568	百润股份	1,700,000	77,044,000.00	4.84
3	002027	分众传媒	12,000,000	66,840,000.00	4.20
4	600519	贵州茅台	43,487	63,616,262.56	3.99
5	002602	世纪华通	4,100,000	62,771,000.00	3.94
6	300751	迈为股份	210,000	62,361,600.00	3.91
7	600859	王府井	1,310,300	59,684,165.00	3.75
8	603489	八方股份	400,000	56,396,000.00	3.54
9	002126	银轮股份	4,600,011	56,304,134.64	3.53
10	300450	先导智能	1,200,000	54,624,000.00	3.43
11	300233	金城医药	1,800,000	52,810,000.00	3.31
12	603801	志邦家居	1,800,000	48,042,000.00	3.02
13	600884	杉杉股份	3,400,000	40,086,000.00	2.52

14	000858	五粮液	226,500	38,758,680.00	2.43
15	600031	三一重工	2,000,000	37,520,000.00	2.36
16	600984	建设机械	1,500,000	37,200,000.00	2.33
17	300630	普利制药	486,432	35,971,646.40	2.26
18	000002	万科 A	1,222,279	31,950,373.06	2.01
19	600779	水井坊	499,800	31,197,516.00	1.96
20	600887	伊利股份	975,297	30,360,995.61	1.91
21	300207	欣旺达	1,500,000	28,350,000.00	1.78
22	603566	普莱柯	999,960	27,688,892.40	1.74
23	603019	中科曙光	700,000	26,880,000.00	1.69
24	002180	纳思达	799,910	26,325,038.10	1.65
25	000651	格力电器	417,480	23,616,843.60	1.48
26	600419	天润乳业	1,500,000	21,885,000.00	1.37
27	300729	乐歌股份	400,000	21,108,000.00	1.32
28	300044	赛为智能	3,000,000	20,130,000.00	1.26
29	603353	和顺石油	400,056	18,798,631.44	1.18
30	300568	星源材质	999,900	18,618,138.00	1.17
31	002174	游族网络	700,000	18,256,000.00	1.15
32	002410	广联达	220,123	15,342,573.10	0.96
33	002655	共达电声	1,000,000	12,660,000.00	0.79
34	600036	招商银行	354,890	11,966,890.80	0.75
35	300760	迈瑞医疗	39,000	11,922,300.00	0.75
36	601318	中国平安	161,108	11,503,111.20	0.72
37	600702	舍得酒业	300,000	11,205,000.00	0.70
38	002044	美年健康	652,065	9,396,256.65	0.59
39	000333	美的集团	145,456	8,696,814.24	0.55
40	603288	海天味业	65,386	8,134,018.40	0.51
41	002013	中航机电	1,000,000	7,900,000.00	0.50
42	600104	上汽集团	451,616	7,672,955.84	0.48
43	603129	春风动力	100,000	6,821,000.00	0.43
44	01066	威高股份	408,457	6,432,260.59	0.40
45	688126	沪硅产业	220,528	5,808,707.52	0.36
46	600570	恒生电子	48,334	5,205,571.80	0.33
47	300059	东方财富	240,000	4,848,000.00	0.30
48	600276	恒瑞医药	50,304	4,643,059.20	0.29
49	600521	华海药业	127,570	4,328,450.10	0.27
50	03690	美团点评-W	26,800	4,208,145.00	0.26
51	300702	天宇股份	36,800	3,912,576.00	0.25
52	600809	山西汾酒	21,100	3,059,500.00	0.19

53	600588	用友网络	45,396	2,001,963.60	0.13
54	600690	海尔智家	97,200	1,720,440.00	0.11
55	000739	普洛药业	63,000	1,467,270.00	0.09
56	601916	浙商银行	294,195	1,159,128.30	0.07
57	688086	紫晶存储	9,361	634,582.19	0.04
58	000888	峨眉山 A	100,000	566,000.00	0.04
59	688166	博瑞医药	8,041	497,657.49	0.03
60	688312	燕麦科技	7,390	308,680.30	0.02
61	603290	斯达半导	956	200,568.80	0.01
62	688159	有方科技	3,341	181,048.79	0.01
63	688090	瑞松科技	3,013	179,122.85	0.01
64	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
65	688398	赛特新材	3,246	176,809.62	0.01
66	688178	万德斯	3,704	147,789.60	0.01
67	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
68	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
69	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
70	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
71	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
72	300783	三只松鼠	800	60,784.00	0.00
73	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
74	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
75	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
76	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
77	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
78	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
79	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
80	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
81	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	002568	百润股份	76,645,768.89	8.68
2	002174	游族网络	72,390,119.97	8.20

3	300233	金城医药	71,255,200.24	8.07
4	002602	世纪华通	70,143,880.73	7.94
5	002027	分众传媒	69,564,168.43	7.88
6	000799	酒鬼酒	68,702,871.27	7.78
7	300159	新研股份	59,404,287.02	6.73
8	002624	完美世界	56,840,167.92	6.44
9	603019	中科曙光	56,638,508.44	6.41
10	300450	先导智能	53,937,203.44	6.11
11	603489	八方股份	53,165,163.01	6.02
12	603690	至纯科技	48,586,915.31	5.50
13	002217	合力泰	48,498,448.14	5.49
14	300123	亚光科技	48,105,918.45	5.45
15	603369	今世缘	47,553,167.17	5.38
16	000858	五粮液	47,109,357.49	5.33
17	300568	星源材质	44,601,198.30	5.05
18	002126	银轮股份	43,759,332.99	4.96
19	300044	赛为智能	43,743,809.20	4.95
20	603801	志邦家居	43,329,090.40	4.91
21	300496	中科创达	43,094,097.37	4.88
22	603359	东珠生态	41,929,708.40	4.75
23	600893	航发动力	41,642,221.00	4.72
24	300751	迈为股份	41,515,016.48	4.70
25	603678	火炬电子	41,459,391.44	4.69
26	000001	平安银行	41,078,289.00	4.65
27	300365	恒华科技	40,887,973.30	4.63
28	600859	王府井	40,508,603.70	4.59
29	002677	浙江美大	39,333,929.80	4.45
30	002171	楚江新材	39,009,942.96	4.42
31	300454	深信服	36,473,643.00	4.13
32	002773	康弘药业	36,379,818.57	4.12
33	600884	杉杉股份	36,328,271.48	4.11
34	002035	华帝股份	35,691,067.00	4.04
35	002422	科伦药业	34,756,844.03	3.94
36	300423	鲁亿通	34,731,694.28	3.93
37	603496	恒为科技	34,581,332.21	3.92
38	603180	金牌厨柜	33,980,171.11	3.85



39	603986	兆易创新	32,214,336.00	3.65
40	600132	重庆啤酒	31,920,142.50	3.61
41	000002	万科 A	31,216,227.01	3.53
42	000938	紫光股份	30,119,609.24	3.41
43	300737	科顺股份	30,089,180.60	3.41
44	300327	中颖电子	29,350,268.33	3.32
45	300207	欣旺达	29,177,837.25	3.30
46	300132	青松股份	28,806,902.00	3.26
47	300630	普利制药	28,678,096.00	3.25
48	600779	水井坊	27,976,076.80	3.17
49	300017	网宿科技	27,514,114.36	3.12
50	000733	振华科技	27,044,584.04	3.06
51	000877	天山股份	25,548,459.06	2.89
52	002180	纳思达	25,527,020.23	2.89
53	300379	东方通	25,526,870.64	2.89
54	600438	通威股份	25,350,035.83	2.87
55	600118	中国卫星	25,115,230.98	2.84
56	600419	天润乳业	25,052,539.60	2.84
57	002635	安洁科技	24,843,524.00	2.81
58	600031	三一重工	24,640,466.94	2.79
59	002168	惠程科技	24,253,364.00	2.75
60	300046	台基股份	24,179,909.50	2.74
61	002214	大立科技	23,155,010.00	2.62
62	002425	凯撒文化	22,863,656.80	2.59
63	600499	科达制造	22,305,802.87	2.53
64	603566	普莱柯	22,244,497.40	2.52
65	300168	万达信息	21,819,120.40	2.47
66	601318	中国平安	21,680,640.00	2.46
67	002582	好想你	21,602,845.54	2.45
68	300729	乐歌股份	20,546,605.00	2.33
69	300131	英唐智控	20,232,546.40	2.29
70	300763	锦浪科技	19,585,067.90	2.22
71	002623	亚玛顿	19,178,841.00	2.17
72	600110	诺德股份	18,965,036.70	2.15
73	600984	建设机械	18,945,050.40	2.15
74	300672	国科微	18,802,890.36	2.13

75	002146	荣盛发展	18,609,620.39	2.11
----	--------	------	---------------	------

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

（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	300123	亚光科技	74,465,952.12	8.43
2	603369	今世缘	60,587,570.62	6.86
3	601318	中国平安	58,732,807.60	6.65
4	002174	游族网络	57,018,456.64	6.46
5	603986	兆易创新	56,570,141.08	6.41
6	300159	新研股份	55,884,841.95	6.33
7	002624	完美世界	53,943,617.10	6.11
8	002425	凯撒文化	49,077,068.89	5.56
9	603690	至纯科技	47,305,665.10	5.36
10	600132	重庆啤酒	44,717,834.78	5.06
11	002773	康弘药业	40,611,018.44	4.60
12	300568	星源材质	40,185,887.32	4.55
13	600893	航发动力	40,098,657.00	4.54
14	000001	平安银行	39,106,280.95	4.43
15	603678	火炬电子	36,755,780.77	4.16
16	603019	中科曙光	36,318,150.60	4.11
17	002217	合力泰	35,981,866.00	4.07
18	002582	好想你	35,960,887.25	4.07
19	600110	诺德股份	35,248,950.51	3.99
20	002035	华帝股份	34,606,695.92	3.92
21	603359	东珠生态	34,484,609.70	3.91
22	002677	浙江美大	34,174,496.55	3.87
23	300737	科顺股份	33,752,992.03	3.82
24	603129	春风动力	33,482,994.95	3.79
25	300423	鲁亿通	33,244,369.39	3.76
26	300496	中科创达	32,647,881.99	3.70
27	300365	恒华科技	32,593,720.68	3.69
28	300046	台基股份	32,229,875.50	3.65
29	603180	金牌厨柜	32,211,600.50	3.65
30	603496	恒为科技	30,927,303.97	3.50

31	002171	楚江新材	30,792,551.64	3.49
32	002146	荣盛发展	29,879,966.00	3.38
33	002422	科伦药业	29,413,998.70	3.33
34	002635	安洁科技	29,339,642.52	3.32
35	300379	东方通	28,884,083.00	3.27
36	000938	紫光股份	28,797,235.94	3.26
37	603801	志邦家居	28,710,260.07	3.25
38	300454	深信服	28,195,911.66	3.19
39	300327	中颖电子	27,867,897.23	3.16
40	000733	振华科技	27,205,982.30	3.08
41	603489	八方股份	26,948,345.21	3.05
42	603799	华友钴业	26,433,472.37	2.99
43	000799	酒鬼酒	26,425,551.74	2.99
44	600438	通威股份	26,110,386.45	2.96
45	300001	特锐德	25,311,018.69	2.87
46	300132	青松股份	25,095,837.25	2.84
47	000877	天山股份	25,065,004.55	2.84
48	600118	中国卫星	24,507,090.76	2.78
49	603898	好莱客	24,504,839.46	2.77
50	600036	招商银行	23,935,877.99	2.71
51	300616	尚品宅配	23,299,304.28	2.64
52	300763	锦浪科技	23,211,651.28	2.63
53	002853	皮阿诺	22,922,936.00	2.60
54	002168	惠程科技	22,664,167.00	2.57
55	002214	大立科技	22,270,193.00	2.52
56	300131	英唐智控	22,073,606.72	2.50
57	600499	科达制造	21,972,403.41	2.49
58	000858	五粮液	21,517,313.00	2.44
59	002737	葵花药业	21,465,476.25	2.43
60	300017	网宿科技	20,477,587.80	2.32
61	300044	赛为智能	20,353,109.10	2.30
62	300059	东方财富	20,280,650.23	2.30
63	603659	璞泰来	19,828,745.00	2.25
64	002191	劲嘉股份	19,738,634.44	2.24
65	002568	百润股份	19,324,024.45	2.19
66	300672	国科微	19,138,133.92	2.17
67	300168	万达信息	18,912,877.18	2.14
68	000915	山大华特	18,716,756.76	2.12

69	603267	鸿远电子	17,762,716.00	2.01
----	--------	------	---------------	------

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	3,263,583,634.49
卖出股票收入（成交）总额	2,881,717,143.12

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

（2）“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,037,500.00	1.57
	其中：政策性金融债	25,037,500.00	1.57
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）	582,341.50	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,619,841.50	1.61

### 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	018007	国开 1801	250,000	25,037,500.00	1.57
2	113029	明阳转债	1,890	216,348.30	0.01
3	110062	烽火转债	1,700	212,007.00	0.01
4	110065	淮矿转债	1,460	153,986.20	0.01

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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

**7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	622,284.74
2	应收证券清算款	2,040,429.33
3	应收股利	-
4	应收利息	810,344.00
5	应收申购款	6,603,632.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,076,690.66

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	--------------

1	113029	明阳转债	216,348.30	0.01
2	110062	烽火转债	212,007.00	0.01
3	110065	淮矿转债	153,986.20	0.01

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300450	先导智能	8,414,000.00	0.53	流通受限

### 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
5,733	174,832.04	811,554,808.49	80.97%	190,757,278.36	19.03%

### 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	740,848.77	0.0739%

### 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年11月28日）基金份额总额	345,734,777.22
本报告期期初基金份额总额	693,615,052.76
本报告期基金总申购份额	926,078,053.79
减：本报告期基金总赎回份额	617,381,019.70
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,002,312,086.85

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



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本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	
光大证券	2	2,005,869,691.97	32.70%	539,628.43	32.78%	-
东方证券	2	1,131,100,987.47	18.44%	303,076.45	18.41%	-
华创证券	2	862,774,487.69	14.07%	233,970.07	14.21%	-
广发证券	2	696,827,488.85	11.36%	186,538.42	11.33%	-
招商证券	2	687,450,446.20	11.21%	184,531.31	11.21%	-
兴业证券	2	683,938,590.31	11.15%	181,449.22	11.02%	-
方正证券	2	65,645,172.66	1.07%	17,212.54	1.05%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金

合计, 不单指股票交易佣金。

## 2、交易单元的选择标准和程序

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、本报告期内本基金无新增租用交易单元。

### 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
光大证券	-	-	1,155,000,000.00	30.61%	-	-
东方证券	-	-	1,060,000,000.00	28.09%	-	-
华创证券	2,430,348.67	87.56%	577,000,000.00	15.29%	-	-
广发证券	-	-	330,000,000.00	8.75%	-	-
招商证券	-	-	275,000,000.00	7.29%	-	-
兴业证券	-	-	326,500,000.00	8.65%	-	-
方正证券	345,379.85	12.44%	50,000,000.00	1.33%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金变更基金经理的	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站	2020年1月8日

	公告	及基金管理人网站	
2	泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下开放式基金在北京蛋卷基金销售有限公司赎回最低份额和持有最低限额的公告	《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3月9日
3	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民生银行股份有限公司直销银行申购及定投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3月12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南京苏宁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3月30日
5	泰康资产管理有限责任公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《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4月28日
6	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加北京新浪仓石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6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
8	泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金在腾安基金销售（深圳）有限公司申购金额下限的公告	《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6月23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

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	20200101 – 20200225	165,721,281.80	0.00	165,721,281.80	0.00	0.00%
	2	20200101 – 20200607	319,244,855.03	0.00	319,244,855.03	0.00	0.00%
	3	20200623 – 20200630	0.00	204,660,550.79	0.00	204,660,550.79	20.42%
	4	20200608 – 20200630	0.00	311,737,036.66	0.00	311,737,036.66	31.10%
个人	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
<p>当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康策略优选灵活配置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》）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