

泰康招泰尊享一年持有期混合型  
证券投资基金  
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 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 7 月 1 日起至 2020 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 泰康招泰尊享一年持有期混合  |
| 交易代码       | 009285   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2020 年 5 月 20 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 2,561,807,621.99 份   |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险的基础上，通过合理配置大类资产和精选投资标的，力求实现基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略       | <p>本基金在严格控制风险的基础上，通过合理配置大类资产和精选投资标的，力求实现基金资产的长期稳健增值。在具体投资上通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。</p> <p>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。在确定组合久期的基础上，运用统计和数量分析技术、对市场利率期限结构历史数据进行分析检验和情景测试，并综合考虑债券市场微观因素，形成对债券收益率曲线形态及其发展趋势的判断。信用策略方面，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估，重点分析发债主体的行业发展前景、市场地位、公司治理、财务质量、融资目的等要素，综合评价其信用等级，分析违约风险以及合理信用利差水平，识别投资价值。</p> |

|                 |  |                  |
|-----------------|--|------------------|
|                 | 股票投资方面，本基金在股票基本面研究的基础上，同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，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，在定性分析的同时结合量化分析方法，精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的国内 A 股及内地与香港股票市场交易互联互通机制下的港股投资标的股票，以此构建股票组合。本基金通过对国内 A 股市场和港股市场跨市场的投资，来达到分散投资风险、增强基金整体收益的目的。 |                  |
| 业绩比较基准          | 本基金的业绩比较基准为：中债新综合全价（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*12%+恒生指数收益率*3%+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，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。本基金投资范围涉及法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，即本基金是一只涉及跨境证券投资的基金。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。   |                  |
| 基金管理人           | 泰康资产管理有限责任公司   |                  |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司   |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 泰康招泰尊享一年持有期混合 A  | 泰康招泰尊享一年持有期混合 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 009285   | 009286           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,696,822,560.07 份   | 864,985,061.92 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2020年7月1日—2020年9月30日） |                 |
|-----------------|---------------------------|-----------------|
|                 | 泰康招泰尊享一年持有期混合 A           | 泰康招泰尊享一年持有期混合 C |
| 1. 本期已实现收益      | 20,285,781.87             | 9,679,108.75    |
| 2. 本期利润         | 8,631,750.63              | 3,743,319.90    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0051                    | 0.0043          |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,706,198,926.00          | 868,817,193.56  |

|             |        |        |
|-------------|--------|--------|
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0055 | 1.0044 |
|-------------|--------|--------|

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) 所述基金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) 本基金合同生效日为 2020 年 5 月 20 日，截止报告期末本基金未满一年。

## 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

泰康招泰尊享一年持有期混合 A

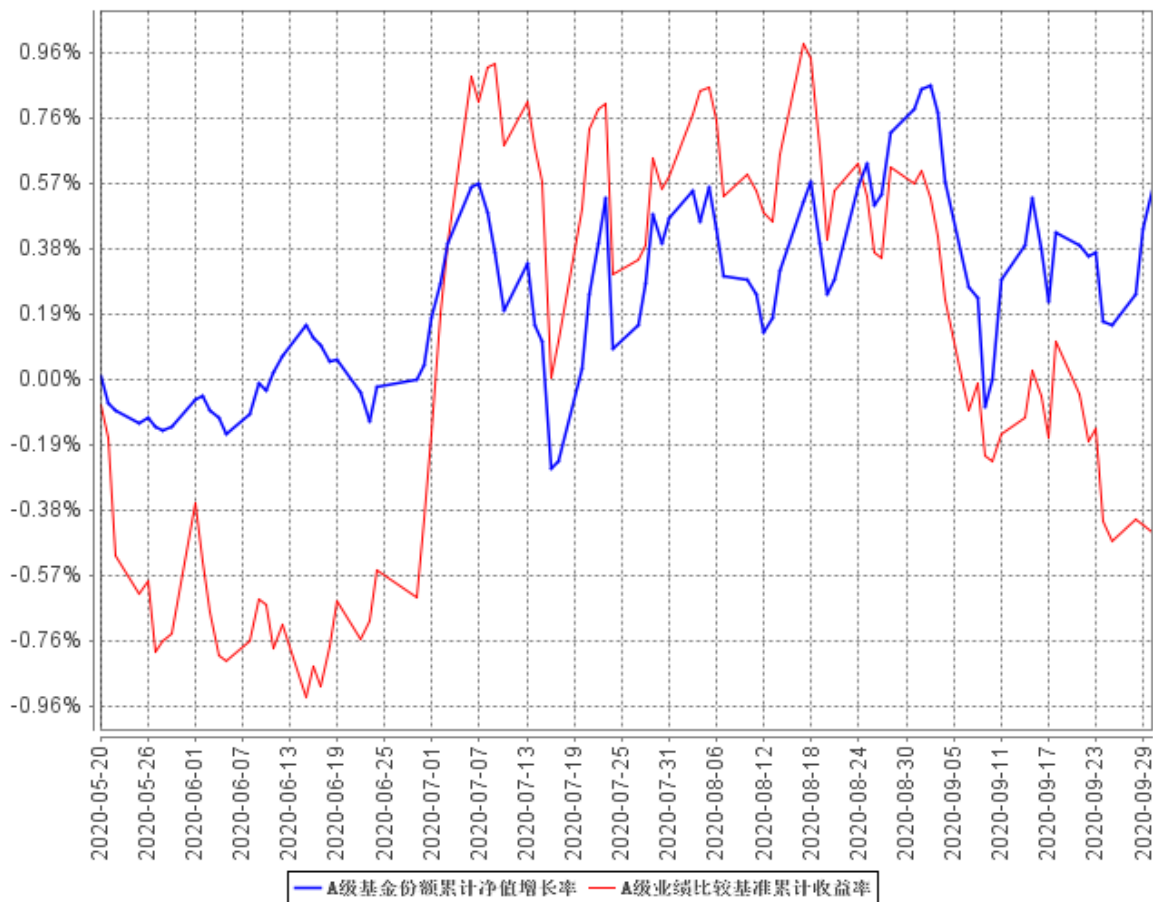
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | 0.51%  | 0.16%     | -0.04%     | 0.19%         | 0.55% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.55%  | 0.13%     | -0.45%     | 0.18%         | 1.00% | -0.05% |

泰康招泰尊享一年持有期混合 C

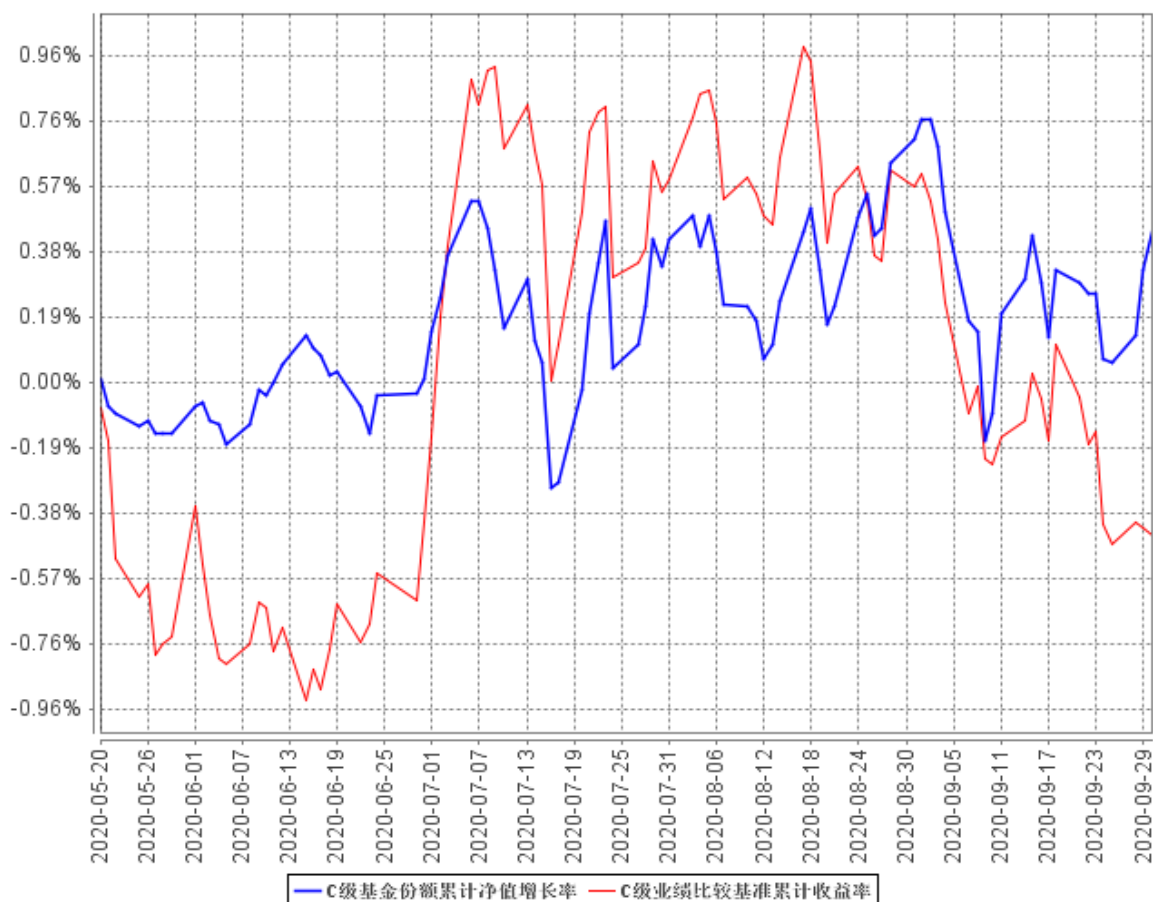
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | 0.43%  | 0.16%     | -0.04%     | 0.19%         | 0.47% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.44%  | 0.13%     | -0.45%     | 0.18%         | 0.89% | -0.05% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 05 月 20 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                     | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------------------------|-----------------|------|--------|---|
|     |                        | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 蒋利娟 | 本基金基金经理、公募事业部固定收益投资负责人 | 2020 年 5 月 20 日 | -    | 12     | 蒋利娟于 2008 年 7 月加入泰康资产，历任集中交易室交易员，固定收益投资部流动性投资经理、固定收益投资经理，固定收益投资中心固定收益投资经理。现任公募事业部固定收益投资负责人。2015 年 6 月 19 日至 |

|     |         |                 |   |    |   |
|-----|---------|-----------------|---|----|---|
|     |         |                 |   |    | <p>今担任泰康薪意保货币市场基金基金经理。2015 年 9 月 23 日至 2020 年 1 月 6 日担任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 8 日至 2016 年 12 月 27 日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 2 月 3 日至今担任泰康稳健增利债券型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月 8 日至今担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 1 月 22 日至今担任泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 15 日至今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 8 月 30 日至 2019 年 5 月 9 日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。2017 年 9 月 8 日至 2020 年 3 月 26 日担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。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 日至今担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 24 日至 2020 年 1 月 14 日担任泰康弘实 3 个月定期开放合型发起式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。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> |
| 桂跃强 | 本基金基金经理 | 2020 年 5 月 20 日 | - | 13 | 桂跃强于 2015 年 8 月加入泰康资产，现担任公募事业   |

|  |                                |  |  |   |
|--|--------------------------------|--|--|---|
|  | 理、公募<br>事业部<br>权益投<br>资负责<br>人 |  |  | <p>部股票投资负责人。2007 年 9 月至 2015 年 8 月曾任职于新华基金管理有限责任公司，担任基金管理部副总监。历任新华泛资源优势灵活配置混合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-2020 年 9 月 22 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。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-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</p> |
|--|--------------------------------|--|--|---|



|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 14 日至今担任泰康蓝筹优势一年持有期股票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 公平交易专项说明

### 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，没有出现本基金管理人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 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，三季度经济继续向上复苏，生产和需求侧数据同步向好。生产侧来看，工业增加值稳步向好，8 月份工业增加值同比已经恢复到了 19 年的正常水平。三大需求也在持续改善，其中出口增速延续了较好的表现，在全球疫情严重的情况下实现了出口份额的提升；投资端基建和地产投资增速维持在高位，而制造业投资在逆周期政策的扶持下也有明显上行；疫情对消费的影响逐步消退。货币条件继续改善，CPI 在合适的水平运行，PPI 则从低位开始明显回升，社融增速在宽信用政策的作用下持续向上。

债券市场方面，利率震荡上行。7月初由于股市出现了快速上涨，强劲的风险偏好带动利率上行。8-9月份，由于超储率处于较低水平，叠加结构性存款的监管趋严，银行缺负债的现象较为突出，存单市场持续提价，带动利率震荡上行；另外，三季度利率债供给压力较大，收益率经常出现一二级联动、共振向上的局面。9月中旬开始，随着海外的不确定性有所增加，叠加商品价格有所下跌，利率趋于震荡。整个季度来看，10Y国债上行约30bp，10Y国开上行约60bp。

权益市场方面，7、8月的经济数据继续好于我们的预期，最新的9月份制造业PMI数据延续了景气区间运行的态势，预示9、10月份的经济复苏势头依然强劲；另一方面，为对冲疫情的不利影响而出台的宽松政策在回归中性，我们认为由于流动性宽松权益资产估值大幅提升的时期已经过去，后续会更为关注业绩的可持续性。从涨跌幅数据和板块上来看，上证综指上涨8.66%，沪深300上涨11.62%，中小板指上涨10.97%，创业板指上涨8.52%。其中，消费、军工、新能源及汽车等板块表现相对较好，通信、计算机、传媒、零售等行业表现不佳。

具体投资策略上，在利率债方面，合理控制组合的久期，减少组合在利率上行期时所承担的风险；在信用债方面，坚持票息策略，在严格控制信用风险的基础上进行个券的精细化研究和投资，挖掘具有一定票息优势的个券。

权益投资方面，在本期，基金在仓位上相机而动。在品种上我们继续坚持原有思路，仍以食品饮料、医药生物、云计算为主，适度加大了对港股科技股的配置。聚焦内需为主、具有明确需求特征且具有竞争优势的行业中的龙头个股，未来仍将重点关注品牌消费品、创新科技制造属性的医药、比较竞争优势的中国制造等行业，均衡策略。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康招泰A基金份额净值为1.0055元，本报告期基金份额净值增长率为0.51%；截至本报告期末泰康招泰C基金份额净值为1.0044元，本报告期基金份额净值增长率为0.43%；同期业绩比较基准增长率为-0.04%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内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者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 280,679,170.65   | 7.43         |
|    | 其中：股票             | 280,679,170.65   | 7.43         |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 3,381,330,823.87 | 89.50        |
|    | 其中：债券             | 3,300,150,823.87 | 87.35        |
|    | 资产支持证券            | 81,180,000.00    | 2.15         |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 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      | 54,634,646.33    | 1.45         |
| 8  | 其他资产              | 61,267,873.48    | 1.62         |
| 9  | 合计                | 3,777,912,514.33 | 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 6,745,200.00 元，占期末资产净值比例为 0.26%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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              | 193,794,687.43 | 7.53         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,956,749.00  | 0.50         |
| E  | 建筑业              | 13,029.12      | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 11,470.24      | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,041,020.56   | 0.08         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 34,334,828.14  | 1.33         |
| J  | 金融业              | 23,830,717.16  | 0.93         |
| K  | 房地产业             | 2,681,565.00   | 0.10         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 14,813.40      | 0.00         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,209,957.34   | 0.16  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 45,133.26      | 0.00  |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 273,933,970.65 | 10.64 |

### 5.2.2 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 | -            | -            |
| C 消费者常用品  | -            | -            |
| D 能源      | -            | -            |
| E 金融      | -            | -            |
| F 医疗保健    | -            | -            |
| G 工业      | -            | -            |
| H 信息技术    | -            | -            |
| I 电信服务    | -            | -            |
| J 公用事业    | -            | -            |
| K 房地产     | 6,745,200.00 | 0.26         |
| 合计        | 6,745,200.00 | 0.26         |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 35,502    | 59,235,087.00 | 2.30         |
| 2  | 002410 | 广联达  | 459,193   | 33,498,129.35 | 1.30         |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 118,100   | 26,100,100.00 | 1.01         |
| 4  | 300233 | 金城医药 | 800,000   | 19,856,000.00 | 0.77         |
| 5  | 300760 | 迈瑞医疗 | 47,500    | 16,530,000.00 | 0.64         |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 218,523   | 15,864,769.80 | 0.62         |
| 7  | 600900 | 长江电力 | 677,300   | 12,956,749.00 | 0.50         |
| 8  | 600809 | 山西汾酒 | 61,500    | 12,188,685.00 | 0.47         |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 2,236,900 | 11,005,548.00 | 0.43         |
| 10 | 300702 | 天宇股份 | 99,646    | 9,059,814.32  | 0.35         |

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。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 129,108,000.00   | 5.01         |
|    | 其中：政策性金融债 | 129,108,000.00   | 5.01         |
| 4  | 企业债券      | 1,048,156,930.50 | 40.70        |
| 5  | 企业短期融资券   | 471,560,000.00   | 18.31        |
| 6  | 中期票据      | 1,105,605,500.00 | 42.94        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 124,787,893.37   | 4.85         |
| 8  | 同业存单      | 420,932,500.00   | 16.35        |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 3,300,150,823.87 | 128.16       |

## 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）     | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 112008212 | 20 中信银行 CD212 | 1,500,000 | 147,840,000.00 | 5.74         |
| 2  | 112018360 | 20 华夏银行 CD360 | 1,400,000 | 137,942,000.00 | 5.36         |
| 3  | 112003078 | 20 农业银行 CD078 | 1,370,000 | 135,150,500.00 | 5.25         |
| 4  | 101901201 | 19 陕煤化 MTN004 | 1,300,000 | 130,026,000.00 | 5.05         |
| 5  | 180205    | 18 国开 05      | 1,200,000 | 129,108,000.00 | 5.01         |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（份）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 168504 | 碧胜 01 优 | 178,000 | 17,800,000.00 | 0.69         |
| 2  | 168756 | 复地 04A  | 140,000 | 14,000,000.00 | 0.54         |
| 3  | 168633 | 赤兔 04 优 | 120,000 | 12,000,000.00 | 0.47         |
| 4  | 169272 | 博雅 1A   | 111,000 | 11,100,000.00 | 0.43         |
| 5  | 168844 | 平裕 4 优  | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.39         |
| 5  | 138793 | 睿思 02A  | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.39         |
| 6  | 168669 | 赤兔 05 优 | 42,800  | 4,280,000.00  | 0.17         |
| 7  | 168955 | 赤兔 06 优 | 20,000  | 2,000,000.00  | 0.08         |

**5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 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。

**5.10 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。

**5.11 投资组合报告附注****5.11.1 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**

国家开发银行的海南省分行等分支机构在本报告编制前一年内受到中国银保监会海南监管局等监管机构的行政处罚。

基金投资该主体相关债券的决策流程符合公司投资制度的规定。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外，其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**5.11.2 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。

**5.11.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 150,011.80    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,561,316.29  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 59,556,545.39 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |

|   |      |               |
|---|------|---------------|
| 7 | 待摊费用 | -             |
| 8 | 其他   | -             |
| 9 | 合计   | 61,267,873.48 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值 (元)      | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------------|---------------|
| 1  | 110062 | 烽火转债     | 15,459,244.20 | 0.60          |
| 2  | 128029 | 太阳转债     | 10,431,443.10 | 0.41          |
| 3  | 132018 | G 三峡 EB1 | 6,972,000.00  | 0.27          |
| 4  | 113025 | 明泰转债     | 5,047,412.50  | 0.20          |
| 5  | 113534 | 鼎胜转债     | 5,019,980.00  | 0.19          |
| 6  | 113020 | 桐昆转债     | 4,334,660.00  | 0.17          |
| 7  | 128099 | 永高转债     | 4,266,989.20  | 0.17          |
| 8  | 128081 | 海亮转债     | 4,183,732.30  | 0.16          |
| 9  | 110051 | 中天转债     | 3,349,360.00  | 0.13          |
| 10 | 110053 | 苏银转债     | 3,325,800.00  | 0.13          |
| 11 | 128102 | 海大转债     | 2,658,150.00  | 0.10          |
| 12 | 128035 | 大族转债     | 2,292,794.10  | 0.09          |
| 13 | 128090 | 汽模转 2    | 1,992,384.00  | 0.08          |
| 14 | 128017 | 金禾转债     | 1,436,730.00  | 0.06          |
| 15 | 128078 | 太极转债     | 1,268,595.70  | 0.05          |
| 16 | 113519 | 长久转债     | 1,081,400.00  | 0.04          |
| 17 | 113537 | 文灿转债     | 940,968.70    | 0.04          |
| 18 | 113571 | 博特转债     | 727,500.00    | 0.03          |
| 19 | 110052 | 贵广转债     | 269,475.00    | 0.01          |
| 20 | 127011 | 中鼎转 2    | 153,225.60    | 0.01          |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-----------------|---------------|----------|
| 1  | 300233 | 金城医药 | 19,856,000.00   | 0.77          | 大宗交易流通受限 |

#### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 泰康招泰尊享一年持有期混合 A  | 泰康招泰尊享一年持有期混合 C |
|---------------------------|------------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,696,822,560.07 | 864,985,061.92  |
| 报告期期间基金总申购份额              | -                | -               |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | -                | -               |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | -                | -               |
| 报告期期末基金份额总额               | 1,696,822,560.07 | 864,985,061.92  |

注：(1) 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。

(2) 本基金合同生效日为 2020 年 5 月 20 日，截止报告期末本基金未满一年。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无



## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金产品资料概要》。

### 9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 9.3 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 10 月 28 日