

# 泰康品质生活混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 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。

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

本报告期为 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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 托管人对本年度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 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>59</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
8.3 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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	77
8.7 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.....	77

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	77
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	77
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	77
8.12 投资组合报告附注 .....	77
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>79</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	79
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>81</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>82</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	82
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	82
11.4 基金投资策略的改变 .....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	82
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	82
11.8 其他重大事件 .....	84
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>93</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	93
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	93
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>94</b>
13.1 备查文件目录 .....	94
13.2 存放地点 .....	94
13.3 查阅方式 .....	94

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰康品质生活混合型证券投资基金	
基金简称	泰康品质生活混合	
基金主代码	010874	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 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	
报告期末基金份额总额	976,909,713.93 份	
下属分级基金的基金简称:	泰康品质生活混合 A	泰康品质生活混合 C
下属分级基金的交易代码:	010874	010875
报告期末下属分级基金的份额总额	535,891,460.37 份	441,018,253.56 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于品质生活主题相关证券，通过精选优质标的和风险控制，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的长期收益。
投资策略	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，通过基金管理人研发构建的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，通过定性定量分析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，确定资产配置比例。本基金所约定的品质生活主题相关证券，主要指在追求品质生活的浪潮中，能够为居民提供优质的产品、服务或解决方案的大消费类行业的公司发行的证券，以及能够通过科技进步为社会带来更多新产品、新服务、新模式的科技类行业公司发行的证券。本基金将根据品质生活主题两大重点领域中相关各行业的特征，从行业发展周期、行业景气度、行业竞争格局、行业发展速度、行业发展趋势与市场空间等多维度评价各行业的投资价值，选择长期符合社会未来发展方向、中短期景气度较高的细分行业进行配置。结合本基金对品质生活主题的界定，通过定量分析和定性分析，自下而上地精选具有较大成长空间、良好公司治理、以及估值相对合理的品质生活主题上市公司进行投资。同时，根据基金流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行利率债、信用债、可转换债券的投资。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、个券精选策略等。在严格控制风险的前提下，通过配置不同类别和期限的债券品种，提高基金非股票资产的收益率。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 *70%+恒生指数收益率 *10%+中债新综合全价（总值）指数收益率 *15%+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。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本

	基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。
--	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康资产管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	张燕
	联系电话	010-58753683	0755-83199084
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4001895522	95555
传真		010-57818785	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		段国圣	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2021 年		2020 年 12 月 30 日(基金合同生效 日)-2020 年 12 月 31 日	
	泰康品质生活混 合 A	泰康品质生活混 合 C	泰康品质生活混 合 A	泰康品质生活混 合 C
本期已 实现收 益	107,476,920.38	66,012,036.28	-17,120.97	-8,518.21
本期利 润	139,214,883.81	75,115,966.69	413,897.09	169,030.42
加权平 均基金 份额本 期利润	0.3503	0.3075	0.0016	0.0016
本期加 权平均 净值利 润率	28.02%	24.25%	0.16%	0.16%
本期基 金份额 净值增 长率	38.29%	37.60%	0.16%	0.16%
3.1.2 期末数 据和指 标	2021 年末		2020 年末	
期末可 供分配 利润	142,488,568.90	114,307,732.76	-17,120.97	-8,518.21
期末可 供分配 基金份 额利润	0.2659	0.2592	-0.0001	-0.0001
期末基 金资产 净值	742,261,226.14	607,816,218.90	260,842,757.64	107,447,104.37
期末基 金份额 净值	1.3851	1.3782	1.0016	1.0016

3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	38.51%	37.82%	0.16%	0.16%

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

泰康品质生活混合 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
过去三个月	9.74%	1.02%	0.71%	0.61%	9.03%	0.41%
过去六个月	5.48%	1.27%	-5.47%	0.81%	10.95%	0.46%
过去一年	38.29%	1.23%	-4.46%	0.90%	42.75%	0.33%
自基金合同生效起至今	38.51%	1.22%	-1.98%	0.91%	40.49%	0.31%

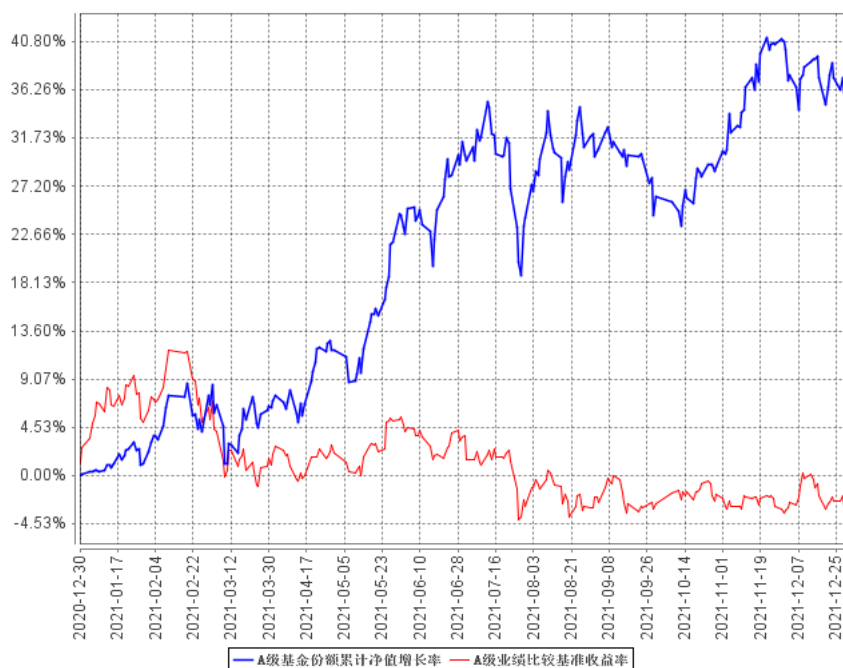
泰康品质生活混合 C

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
过去三个月	9.60%	1.02%	0.71%	0.61%	8.89%	0.41%
过去六个月	5.21%	1.27%	-5.47%	0.81%	10.68%	0.46%
过去一年	37.60%	1.23%	-4.46%	0.90%	42.06%	0.33%
自基金合同生效起至今	37.82%	1.22%	-1.98%	0.91%	39.80%	0.31%

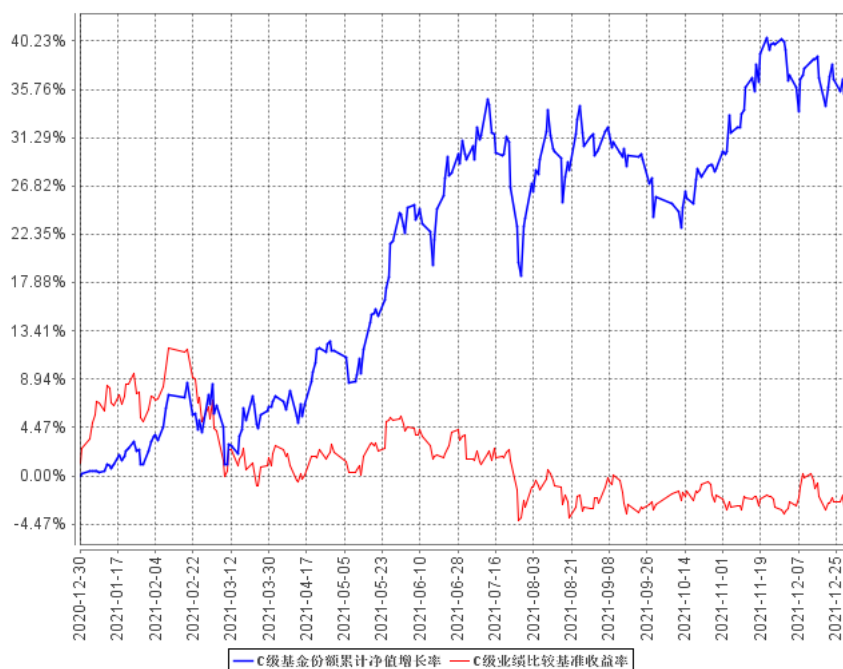


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

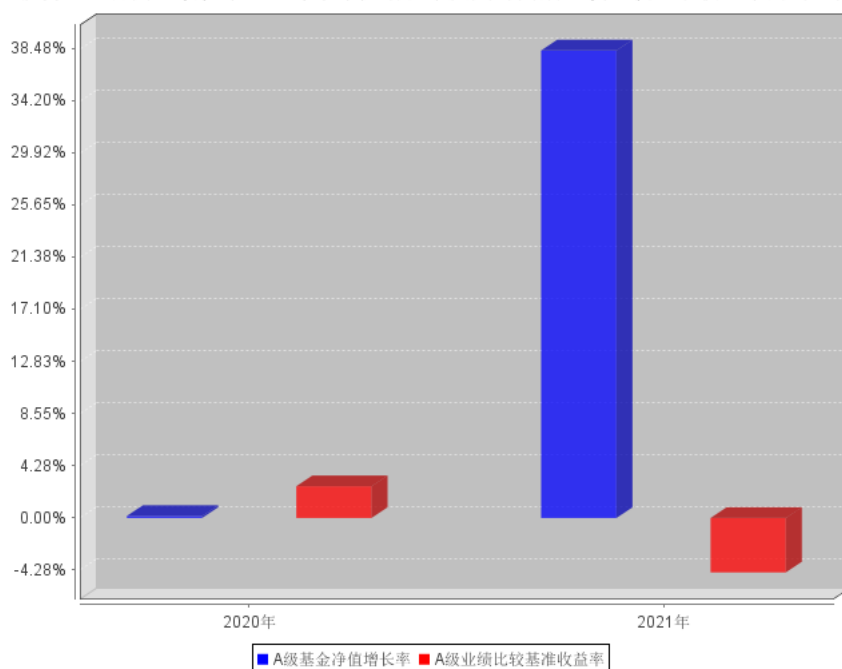


注：1、本基金基金合同于 2020 年 12 月 30 日生效。

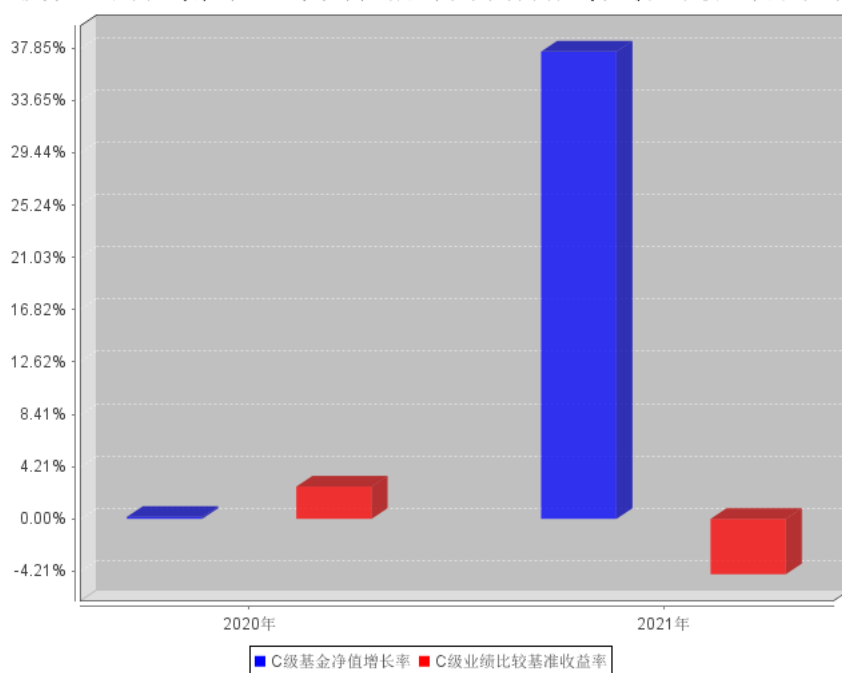
2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

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



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



注：本基金成立于2020年12月30日，2020年度净值增长率的计算期间为2020年12月30日至2020年12月31日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2020年12月30日）至报告期截止日（2021年12月31日）未进行利润分配。

## § 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 2021 年 12 月 31 日，公司管理资产总规模超过 27000 亿元，其中受托管理的第三方资产总规模近 17000 亿元，另类投资管理规模超 5000 亿元，养老金管理规模超 6400 亿元。根据人社部公开数据，2021 年三季度末，泰康资产受托管理的企业年金规模超 4100 亿元，位于市场前列。

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 2021 年 12 月 31 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、泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康蓝筹优势一年持有期股票型证券投资基金、泰康创新成长混合型证券投资基金、泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、泰康优势企业混合型证券投资基金、泰康品质生活混合型证券投资基金、泰康合润混合型证券投资基金、泰康福泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、泰康浩泽混合型证券投资基金、泰康安泽中短债债券型证券投资基金、泰康福泽积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、泰康优势精选三年持有期混合型基金中基金、泰康国证公共卫生与健康交易型开放式指数证券投资基金、泰康鼎泰一年持有期混合型证券投资基金、泰康研究精选股票型发起式证券投资基金, 共 63 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		
宋仁杰	本基金基金经理	2020年12月30日	-	10	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。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。2020年12月30日至今担任泰康品质生活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的披露日期。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守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 公平交易制度和控制方法

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

公司公平交易管理制度要求交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源，保证各投资组合获得公平的交易机会。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2021 年经济整体处于疫情恢复之中，但是经济恢复力度略低于市场预期，同时流动性政策宽松程度超过市场预期，我们中长期依然对权益市场乐观，中短期认为市场将继续震荡。

权益市场方面，2021 年市场大幅波动，过去表现靓丽的核心资产出现明显回调，以新能源为核心的成长股表现领先。

投资操作上，本基金聚焦消费和新兴成长，坚持以获取稳健的相对收益为目标，行业均衡配置，个股适度集中，基于空间和确定性进行组合构建。在行业配置方面，本基金以食品饮料、家电、轻工、新能源等行业为主，但是我们在新能源行业的操作方面减持过早，错失了部分收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康品质生活 A 基金份额净值为 1.3851 元，本报告期基金份额净值增长率为 38.29%；截至本报告期末泰康品质生活 C 基金份额净值为 1.3782 元，本报告期基金份额净值增长率为 37.60%；同期业绩比较基准增长率为-4.46%。

### 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 2022 年，宏观经济有望从底部逐步恢复，可能是稳增长政策逐步落地见效的过程。政策上可能更多体现为在长效机制的框架下的陆续边际放松和纠偏，力度不会很大，但在基建、地产等多个领域都会有一定程度的对冲，叠加制造业的景气，宏观经济有望见到社融率先企稳回升、工业和投资指标逐步企稳的过程。出口面临海外供需两方面较大的不确定性，但压力可能更多体现在下半年，上半年预计维持韧性，叠加政策靠前发力，经济动能有望在 1-2 季度缓慢恢复。

权益市场方面，我们对市场的判断依然维持中长期乐观，中短期震荡的判断。从长期的角度，我们依然对国内权益市场充满信心，从宏观经济、流动性、估值和政策维度来看，中长期国内权益市场都很有吸引力。

投资上，对 2022 年，我们认为国内依然面临经济下滑和国际关系复杂等一系列不确定性环境，短期我们认为需要多关注风险。在配置上，品质生活维持较多的中小市值企业配置。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：

本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，定期与不定期地对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；建立可供投资的基础库和禁投库，并适时对个券进行维护更新，通过信息技术建立完善投资交易监控系统；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；内部监察稽核人员日常对基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司公募业务风险控制委员会。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 21008 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰康品质生活混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰康品质生活混合型证券投资基金(以下简称“泰康品质生活混合”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了泰康品质生活混合 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰康品质生活混合,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	泰康品质生活混合的基金管理人泰康资产管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部

	<p>控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰康品质生活混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰康品质生活混合、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰康品质生活混合的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰康品质生活混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审</p>

	<p>计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰康品质生活混合不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇   周祎
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：泰康品质生活混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	74,850,913.20	367,706,934.50
结算备付金		7,451,086.77	-
存出保证金		706,323.88	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,237,859,656.91	48,964,160.40
其中：股票投资		1,235,082,048.99	48,964,160.40
基金投资		-	-
债券投资		2,777,607.92	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	32,000,000.00	250,000,000.00
应收证券清算款		1,722,076.13	-
应收利息	7.4.7.5	3,912.27	10,724.79
应收股利		-	-
应收申购款		1,581,006.90	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,356,174,976.06	666,681,819.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		809,612.21	298,359,882.15
应付赎回款		2,125,059.53	-
应付管理人报酬		1,690,269.20	15,070.25
应付托管费		281,711.53	2,511.71
应付销售服务费		250,465.93	1,465.58
应付交易费用	7.4.7.7	841,599.15	13,027.99
应交税费		6.60	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	98,806.87	-
负债合计		6,097,531.02	298,391,957.68
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	976,909,713.93	367,706,934.50
未分配利润	7.4.7.10	373,167,731.11	582,927.51
所有者权益合计		1,350,077,445.04	368,289,862.01
负债和所有者权益总计		1,356,174,976.06	666,681,819.69

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，泰康品质生活混合 A 基金份额净值 1.3851 元，基金份额总额 535,891,460.37 份；泰康品质生活混合 C 基金份额净值 1.3782 元，基金份额总额 441,018,253.56 份。泰康品质生活混合份额总额合计为 976,909,713.93 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰康品质生活混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日(基 金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		239,349,966.02	619,291.48
1.利息收入		1,297,793.55	10,724.79
其中：存款利息收入	7.4.7.11	330,439.59	10,724.79
债券利息收入		23,556.65	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		943,797.31	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		196,233,987.68	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	189,833,514.36	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	284,540.56	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	6,115,932.76	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	40,841,893.84	608,566.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	976,290.95	-
<b>减：二、费用</b>		25,019,115.52	36,363.97
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,945,479.68	15,070.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,990,913.30	2,511.71
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,521,769.27	1,465.58
4. 交易费用	7.4.7.19	9,306,982.38	17,316.43
5. 利息支出		417.37	-
其中：卖出回购金融资产支出		417.37	-
6. 税金及附加		3.10	-
7. 其他费用	7.4.7.20	253,550.42	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		214,330,850.50	582,927.51
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		214,330,850.50	582,927.51

注：本基金合同生效日为 2020 年 12 月 30 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2020 年 12 月 30 日至 2020 年 12 月 31 日止期间。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康品质生活混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	367,706,934.50	582,927.51	368,289,862.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	214,330,850.50	214,330,850.50
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）	609,202,779.43	158,253,953.10	767,456,732.53
其中：1. 基金申购款	1,014,168,347.51	266,168,235.73	1,280,336,583.24
2. 基金赎回款	-404,965,568.08	-107,914,282.63	-512,879,850.71
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)	976,909,713.93	373,167,731.11	1,350,077,445.04
项目	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生效日)至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	367,706,934.50	-	367,706,934.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	582,927.51	582,927.51
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)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
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)	367,706,934.50	582,927.51	368,289,862.01

注: 本基金合同生效日为 2020 年 12 月 30 日, 上年度可比期间是指自基金合同生效日 2020 年 12 月 30 日至 2020 年 12 月 31 日止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰康品质生活混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3134号《关于准予泰康品质生活混合型证券投资基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康品质生活混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 367,666,105.87 元,业经毕马威华振会计师事务所



所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2000930 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康品质生活混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 12 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 367,706,934.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 40,828.63 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康资产管理有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《泰康品质生活混合型证券投资基金招募说明书》,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。在投资者认购/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《泰康品质生活混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要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、存托凭证)、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”)、股指期货、国债期货、债券资产(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、信用衍生品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:股票投资占基金资产比例为 60%-95%,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;投资于品质生活主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;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。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率\*70%+恒生指数收益率\*10%+中债新综合全价(总值)指数收益率\*15%+金融机构人民币活期存款利率(税后)\*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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》、《泰康品质生活混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其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。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本

基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。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或票面利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确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### 1. 估值方法及关键假设

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

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[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。

## 2. 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021 年 12 月 31 日	
	上年度末	
	2020 年 12 月 31 日	
活期存款	74,850,913.20	367,706,934.50
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：	74,850,913.20	367,706,934.50

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,194,062,396.38	1,235,082,048.99	41,019,652.61	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,346,800.00	2,777,607.92	430,807.92
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,346,800.00	2,777,607.92	430,807.92
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,196,409,196.38	1,237,859,656.91	41,450,460.53	
项目	上年度末			
	2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	



股票		48,355,593.71	48,964,160.40	608,566.69
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		-	-	-
其他		-	-	-
合计		48,355,593.71	48,964,160.40	608,566.69

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	32,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	32,000,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	250,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	250,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	8,289.15	10,724.79
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	3,855.95	-
应收债券利息	700.68	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-9,480.41	-
应收申购款利息	123.88	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	423.02	-
合计	3,912.27	10,724.79

#### 7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	841,599.15	13,027.99
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	841,599.15	13,027.99

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	806.87	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	98,000.00	-
合计	98,806.87	-

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰康品质生活混合 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	260,428,860.55	260,428,860.55
本期申购	521,775,659.47	521,775,659.47
本期赎回（以“-”号填列）	-246,313,059.65	-246,313,059.65
- 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	535,891,460.37	535,891,460.37

金额单位：人民币元

泰康品质生活混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	107,278,073.95	107,278,073.95
本期申购	492,392,688.04	492,392,688.04
本期赎回（以“-”号填列）	-158,652,508.43	-158,652,508.43
- 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	441,018,253.56	441,018,253.56

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2020 年 12 月 21 日至 2020 年 12 月 25 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 367,666,105.87 元，其中 A 类基金有效净认购资金为 260,397,556.01 元，C 类基金有效净认购资金为 107,268,549.86 元。根据《泰康品质生活混合型证券投资基金招募说明书》和《泰康品质生活混合型证券投资基金份额发售公告》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 31,304.54 元和认购 C 类基金资金产生的利息收入 9,524.09 元在本基金成立后，分别折算为 31,304.54 份 A 类基金份额和 9,524.09 份 C 类基金份额，划入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰康品质生活混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-17,120.97	431,018.06	413,897.09
本期利润	107,476,920.38	31,737,963.43	139,214,883.81
本期基金份额交易产生的变动数	35,028,769.49	31,712,215.38	66,740,984.87
其中：基金申购款	70,579,004.73	59,640,176.93	130,219,181.66

基金赎回款	-35,550,235.24	-27,927,961.55	-63,478,196.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	142,488,568.90	63,881,196.87	206,369,765.77

单位：人民币元

泰康品质生活混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,518.21	177,548.63	169,030.42
本期利润	66,012,036.28	9,103,930.41	75,115,966.69
本期基金份额交易产生的变动数	48,304,214.69	43,208,753.54	91,512,968.23
其中：基金申购款	75,901,214.71	60,047,839.36	135,949,054.07
基金赎回款	-27,597,000.02	-16,839,085.82	-44,436,085.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	114,307,732.76	52,490,232.58	166,797,965.34

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年12月30日(基金合同生效日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	178,686.87	10,724.79
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	137,375.63	-
其他	14,377.09	-
合计	330,439.59	10,724.79

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年12月30日(基金合同生效日)至2020年12月31日
卖出股票成交总额	5,121,809,579.53	-
减：卖出股票成本总额	4,931,976,065.17	-
买卖股票差价收入	189,833,514.36	-

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金 合同生效日)至2020年12月 31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	284,540.56	-
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	284,540.56	-

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金 合同生效日)至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,082,436.72	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,623,460.00	-
减：应收利息总额	174,436.16	-
买卖债券差价收入	284,540.56	-

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金无衍生工具收益。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,115,932.76	-
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	6,115,932.76	-

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生效日)至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	40,841,893.84	608,566.69
——股票投资	40,411,085.92	608,566.69
——债券投资	430,807.92	-
——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	40,841,893.84	608,566.69

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生效日)至2020年12月31日
基金赎回费收入	919,235.56	-
基金转换费收入	57,055.39	-
合计	976,290.95	-

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. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中：申购费补差收取具体情

况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生 效日)至2020年12月31日
交易所市场交易费用	9,306,982.38	17,316.43
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	9,306,982.38	17,316.43

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同 生效日)至2020年12月31日
审计费用	93,500.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
其他	400.00	-
银行费用	23,150.42	-
债券帐户维护费	16,500.00	-
合计	253,550.42	-

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 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。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东
--------------	-----------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 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 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,945,479.68	15,070.25
其中：支付销售机构的客户维护费	2,993,310.30	5,920.76

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 × 1.50% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,990,913.30	2,511.71

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

###### 7.4.10.2.3 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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费



	泰康品质生活混合 A	泰康品质生活混合 C	合计
招商银行	-	183,011.94	183,011.94
泰康资产管理有限任 公司	-	1,202,623.49	1,202,623.49
合计	-	1,385,635.43	1,385,635.43
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康品质生活混合 A	泰康品质生活混合 C	合计
招商银行	-	372.92	372.92
泰康资产管理有限任 公司	-	1,015.74	1,015.74
合计	-	1,388.66	1,388.66

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.50% 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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 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 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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。

##### 7.4.10.4.2 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 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	泰康品质生活混合 A	泰康品质生活混合 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	52,201,646.78	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	52,201,646.78	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.7411%	-

项目	上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	泰康品质生活混合 A	泰康品质生活混合 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入及自动升降级调增份额，期间赎回/卖出总份额含转换出及自动升降级调减份额；

2. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付；

3. 上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

#### 7.4.10.5.2 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，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

#### 7.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生效日) 至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	74,850,913.20	178,686.87	367,706,934.50	10,724.79

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 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 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

：本报告期本基金无利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年1月7日	网下新股流通受限	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	网下新股流通受限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	网下新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
002991	甘源食品	2021年12月10日	2022年6月13日	大宗交易流通受限	53.46	70.56	109,600	5,859,216.00	7,733,376.00	-

601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	新 股 定 流 受 通 限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688779	长远锂科	2021年8月3日	2022年2月11日	新 股 定 流 受 通 限	5.65	22.86	40,439	228,480.35	924,435.54	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2022年1月4日	新 股 定 流 受 通 限	38.85	293.00	2,149	83,488.65	629,657.00	-
688733	壹石通	2021年8月10日	2022年2月17日	新 股 定 流 受 通 限	15.49	75.36	3,409	52,805.41	256,902.24	-
688091	上海谊众	2021年9月1日	2022年3月9日	新 股 定 流 受 通 限	38.10	42.81	3,294	125,501.40	141,016.14	-
688697	纽威数控	2021年9月9日	2022年3月17日	新 股 定 流 受 通 限	7.55	16.03	5,837	44,069.35	93,567.11	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新 股 定 流 受 通 限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新 股 定 流 受 通 限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新 股 定 流 受 通 限	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-

				限						
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新锁定流通股	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新锁定流通股	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新锁定流通股	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新锁定流通股	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新锁定流通股	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新锁定流通股	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新锁定流通股	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新锁定流通股	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新锁定流通股	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-

			日	通 受							
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新 股 锁 定 期 流 通 受	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-	
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新 股 锁 定 期 流 通 受	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-	
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新 股 锁 定 期 流 通 受	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-	
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新 股 锁 定 期 流 通 受	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-	
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新 股 锁 定 期 流 通 受	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-	
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新 股 锁 定 期 流 通 受	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-	
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新 股 锁 定 期 流 通 受	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-	
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新 股 锁 定 期 流 通 受	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-	
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月	新 股 锁 定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-	

		日	月 20	期 流						
			日	通 受						
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	新 股 锁 定 期 流 通 受	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新 股 锁 定 期 流 通 受	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新 股 锁 定 期 流 通 受	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新 股 锁 定 期 流 通 受	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新 股 锁 定 期 流 通 受	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新 股 锁 定 期 流 通 受	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新 股 锁 定 期 流 通 受	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业	2021年	2022	网下	100.00	100.00	13,210	1,321,000.00	1,321,000.00	-

	转债	12月 29日	年1 月14 日	新债 流通 受限					
--	----	------------	----------------	----------------	--	--	--	--	--

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、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，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、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



参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 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，制定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。

#### 7.4.13.2 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人招商银行股份有限公司，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。

##### 7.4.13.2.1 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 2021年12月31日	上年度末 2020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。

##### 7.4.13.2.2 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 2021年12月31日	上年度末 2020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。

#### 7.4.13.2.3 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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。

#### 7.4.13.2.4 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	1,321,000.00	0.00
AAA 以下	1,456,607.92	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	2,777,607.92	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。

#### 7.4.13.2.5 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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。

#### 7.4.13.2.6 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	上年度末
--------	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 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。

### 7.4.13.3 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 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 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 7.4.12。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 2021 年 12 月 31 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 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	74,850,913.20	-	-	-	74,850,913.20
结算备付金	7,451,086.77	-	-	-	7,451,086.77
存出保证金	706,323.88	-	-	-	706,323.88
交易性金融资产	-	-2,777,607.92	1,235,082,048.99	1,237,859,656.91	
买入返售金融资产	32,000,000.00	-	-	-	32,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,722,076.13	1,722,076.13
应收利息	-	-	-	3,912.27	3,912.27
应收申购款	577,847.12	-	-	1,003,159.78	1,581,006.90
资产总计	115,586,170.97	-2,777,607.92	1,237,811,197.17	1,356,174,976.06	
负债					
应付证券清算款	-	-	-	809,612.21	809,612.21
应付赎回款	-	-	-	2,125,059.53	2,125,059.53
应付管理人报酬	-	-	-	1,690,269.20	1,690,269.20
应付托管费	-	-	-	281,711.53	281,711.53
应付销售服务费	-	-	-	250,465.93	250,465.93
应付交易费用	-	-	-	841,599.15	841,599.15
应交税费	-	-	-	6.60	6.60
其他负债	-	-	-	98,806.87	98,806.87
负债总计	-	-	-	6,097,531.02	6,097,531.02
利率敏感度缺口	115,586,170.97	-2,777,607.92	1,231,713,666.15	1,350,077,445.04	
上年度末 2020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	367,706,934.50	-	-	-	367,706,934.50
交易性金融资产	-	-	-	48,964,160.40	48,964,160.40
买入返售金融资产	250,000,000.00	-	-	-	250,000,000.00
应收利息	-	-	-	10,724.79	10,724.79
资产总计	617,706,934.50	-	-	48,974,885.19	666,681,819.69
负债					
应付证券清算款	-	-	-	298,359,882.15	298,359,882.15
应付管理人报酬	-	-	-	15,070.25	15,070.25
应付托管费	-	-	-	2,511.71	2,511.71
应付销售服务费	-	-	-	1,465.58	1,465.58
应付交易费用	-	-	-	13,027.99	13,027.99
负债总计	-	-	-	298,391,957.68	298,391,957.68
利率敏感度缺口	617,706,934.50	-	-	-249,417,072.49	368,289,862.01

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。

**7.4.13.4.1.2 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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	40,340.26	0.00
市场利率上调 0.25%	-39,648.46	0.00	

**7.4.13.4.2 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 12 月 31 日，本基金无持有以港币计价的资产，无以外币计价的负债，无资产负债表外汇风险敞口）。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 48,552,400.00 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 48,552,400.00 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 485,524.00 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-485,524.00 元。

**7.4.13.4.3 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。本基金股票投资占基金资产比例为 60%-95%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；投资于品质生活主题相关证券的比例不低于非现金基金资产 80%；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。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	1,235,082,048.99	91.48	48,964,160.40	13.30
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	1,235,082,048.99	91.48	48,964,160.40	13.30

#### 7.4.13.4.3.2 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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的权益指数上涨 5%	39,859,812.07	0.00
业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-39,859,812.07	0.00	

注：于 2020 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 7.4.14 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 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,223,684,977.79 元，属于第二层次的余额为 2,274,964.13 元，属于第三层次的余额为 11,899,714.99 元（2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 48,964,160.40 元，无属于第二、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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具的金额为 11,899,714.99 元（2020 年 12 月 31 日：无）。2021 年度购买第三层次金融工具的金额为 8,392,561.58 元，计入当期损益的利得或损失金额为 3,507,153.41 元，均计入利润表中的公允价值变动损益项目（2020 年度：无）。于 2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动-公允价值变动损益金额为 3,507,153.41 元（2020 年 12 月 31 日：无）。

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融资产采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2020 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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23

号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,235,082,048.99	91.07
	其中：股票	1,235,082,048.99	91.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,777,607.92	0.20
	其中：债券	2,777,607.92	0.20
	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	32,000,000.00	2.36
	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	82,301,999.97	6.07
8	其他各项资产	4,013,319.18	0.30
9	合计	1,356,174,976.06	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 48,552,400.00 元，占期末资产净值比例为 3.60%。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	925,700,969.41	68.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	34,225.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	150,243,562.73	11.13
J	金融业	34,479,789.68	2.55
K	房地产业	34,946,132.70	2.59
L	租赁和商务服务业	40,950,000.00	3.03

M	科学研究和技术服务业	89,656.54	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	39,667.07	0.00
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	29,517.67	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,186,529,648.99	87.89

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
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	48,552,400.00	3.60
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	48,552,400.00	3.60

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603639	海利尔	2,230,000	55,995,300.00	4.15
2	600519	贵州茅台	27,000	55,350,000.00	4.10
3	00700	腾讯控股	130,000	48,552,400.00	3.60
4	603109	神驰机电	1,600,000	45,616,000.00	3.38
5	300451	创业慧康	4,000,026	44,720,290.68	3.31
6	300659	中孚信息	930,000	42,175,500.00	3.12
7	002027	分众传媒	5,000,000	40,950,000.00	3.03
8	002991	甘源食品	540,000	40,572,896.00	3.01
9	600079	人福医药	1,800,000	40,536,000.00	3.00
10	000537	广宇发展	1,450,047	34,946,132.70	2.59
11	300033	同花顺	238,000	34,410,040.00	2.55

12	002897	意华股份	600,000	33,966,000.00	2.52
13	002568	百润股份	560,000	33,504,800.00	2.48
14	002389	航天彩虹	1,200,000	33,360,000.00	2.47
15	300990	同飞股份	250,000	31,940,000.00	2.37
16	605099	共创草坪	900,000	31,815,000.00	2.36
17	603043	广州酒家	1,300,000	31,278,000.00	2.32
18	603267	鸿远电子	170,020	30,508,388.80	2.26
19	605186	健麾信息	840,000	30,458,400.00	2.26
20	603678	火炬电子	400,000	30,260,000.00	2.24
21	688211	中科微至	400,000	30,000,000.00	2.22
22	002446	盛路通信	4,948,900	29,940,845.00	2.22
23	688257	新锐股份	450,000	29,790,000.00	2.21
24	002454	松芝股份	3,500,000	29,435,000.00	2.18
25	002937	兴瑞科技	1,400,000	28,224,000.00	2.09
26	688345	博力威	460,000	27,416,000.00	2.03
27	300088	长信科技	2,000,000	26,560,000.00	1.97
28	002271	东方雨虹	500,000	26,340,000.00	1.95
29	688232	新点软件	600,020	26,070,869.00	1.93
30	002391	长青股份	3,000,000	24,240,000.00	1.80
31	000657	中钨高新	1,500,000	24,120,000.00	1.79
32	688556	高测股份	300,066	20,251,454.34	1.50
33	600479	千金药业	1,600,020	20,080,251.00	1.49
34	300785	值得买	264,600	18,982,404.00	1.41
35	300041	回天新材	1,000,000	18,540,000.00	1.37
36	688191	智洋创新	750,000	16,575,000.00	1.23
37	300610	晨化股份	800,080	16,105,610.40	1.19
38	002384	东山精密	570,000	15,447,000.00	1.14
39	002402	和而泰	500,000	13,715,000.00	1.02
40	000768	中航西飞	300,000	10,950,000.00	0.81
41	000860	顺鑫农业	160,700	6,135,526.00	0.45
42	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.12
43	688779	长远锂科	40,439	924,435.54	0.07
44	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.06
45	688499	利元亨	2,149	629,657.00	0.05
46	688733	壹石通	3,409	256,902.24	0.02
47	688091	上海谊众	3,294	141,016.14	0.01
48	688697	纽威数控	5,837	93,567.11	0.01
49	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
50	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.01

51	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
52	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
53	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
54	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
55	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
56	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
57	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
58	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
59	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
60	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
61	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
62	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
63	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
64	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
65	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
66	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
67	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
68	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
69	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
70	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
71	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
72	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
73	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
74	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
75	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
76	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
77	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
78	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
79	000888	峨眉山 A	800	5,280.00	0.00
80	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
81	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
82	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
83	301053	远信工业	155	4,460.90	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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002568	百润股份	81,373,556.78	22.09
2	688345	博力威	78,854,906.93	21.41
3	00700	腾讯控股	70,597,341.63	19.17
4	002304	洋河股份	69,303,979.00	18.82
5	600519	贵州茅台	64,738,940.00	17.58
6	002027	分众传媒	61,731,342.00	16.76
7	605186	健麾信息	58,738,554.46	15.95
8	603801	志邦家居	58,680,722.02	15.93
9	000063	中兴通讯	58,383,313.86	15.85
10	603109	神驰机电	55,491,487.50	15.07
11	002466	天齐锂业	53,511,282.03	14.53
12	300059	东方财富	53,404,415.69	14.50
13	603639	海利尔	52,917,951.36	14.37
14	002318	久立特材	51,904,670.05	14.09
15	300911	亿田智能	51,833,428.04	14.07
16	603993	洛阳钼业	48,880,518.00	13.27
17	000537	广宇发展	48,860,126.97	13.27
18	300813	泰林生物	48,091,665.54	13.06
19	600079	人福医药	47,895,344.00	13.00
20	605099	共创草坪	47,353,371.62	12.86
21	688056	莱伯泰科	46,946,249.27	12.75
22	000938	紫光股份	45,077,631.03	12.24
23	300049	福瑞股份	44,918,343.74	12.20
24	000799	酒鬼酒	44,503,710.00	12.08
25	300203	聚光科技	40,659,279.77	11.04
26	300659	中孚信息	40,351,797.94	10.96
27	603678	火炬电子	40,005,645.90	10.86
28	002396	星网锐捷	39,797,753.56	10.81
29	002454	松芝股份	39,225,423.50	10.65
30	605305	中际联合	39,026,818.80	10.60
31	002614	奥佳华	38,836,706.64	10.55
32	300785	值得买	38,150,793.00	10.36
33	300142	沃森生物	38,143,112.32	10.36
34	300451	创业慧康	38,057,599.04	10.33

35	600346	恒力石化	36,724,361.00	9.97
36	300035	中科电气	36,402,340.64	9.88
37	300033	同花顺	36,315,628.00	9.86
38	601658	邮储银行	35,747,568.74	9.71
39	688257	新锐股份	34,845,592.58	9.46
40	002446	盛路通信	34,611,809.10	9.40
41	300036	超图软件	34,037,194.68	9.24
42	002149	西部材料	33,996,420.00	9.23
43	002991	甘源食品	33,876,671.76	9.20
44	603883	老百姓	33,610,376.52	9.13
45	300680	隆盛科技	33,298,562.99	9.04
46	688408	中信博	33,169,331.39	9.01
47	300568	星源材质	33,048,209.92	8.97
48	002897	意华股份	33,013,677.92	8.96
49	000069	华侨城 A	32,562,845.01	8.84
50	002389	航天彩虹	32,450,193.73	8.81
51	603985	恒润股份	32,441,213.42	8.81
52	601615	明阳智能	32,373,137.84	8.79
53	300922	天秦装备	32,372,387.25	8.79
54	600862	中航高科	32,203,775.00	8.74
55	603218	日月股份	31,590,351.12	8.58
56	301030	仕净科技	31,298,595.91	8.50
57	688211	中科微至	31,284,596.64	8.49
58	600436	片仔癀	31,207,345.48	8.47
59	603330	上海天洋	30,780,624.75	8.36
60	002192	融捷股份	30,497,892.00	8.28
61	603043	广州酒家	30,399,644.60	8.25
62	000301	东方盛虹	30,392,715.00	8.25
63	000625	长安汽车	30,353,792.40	8.24
64	603267	鸿远电子	30,262,562.60	8.22
65	600521	华海药业	30,252,642.60	8.21
66	300233	金城医药	29,760,042.32	8.08
67	300990	同飞股份	29,656,946.00	8.05
68	688033	天宜上佳	29,351,616.73	7.97
69	002373	千方科技	29,298,206.22	7.96
70	002937	兴瑞科技	29,125,244.52	7.91



71	002028	思源电气	29,122,014.14	7.91
72	000657	中钨高新	28,713,066.60	7.80
73	603369	今世缘	28,661,394.00	7.78
74	002240	盛新锂能	28,630,809.10	7.77
75	300193	佳士科技	28,621,061.20	7.77
76	603606	东方电缆	28,278,684.00	7.68
77	600132	重庆啤酒	27,973,393.47	7.60
78	000738	航发控制	27,825,709.70	7.56
79	002013	中航机电	27,606,057.00	7.50
80	002687	乔治白	27,540,604.62	7.48
81	002933	新兴装备	27,260,656.00	7.40
82	002154	报喜鸟	26,724,835.74	7.26
83	600821	金开新能	26,611,771.00	7.23
84	002475	立讯精密	26,132,609.06	7.10
85	603806	福斯特	26,097,857.00	7.09
86	688556	高测股份	26,025,003.18	7.07
87	002829	星网宇达	25,994,846.00	7.06
88	002664	长鹰信质	25,989,567.00	7.06
89	688232	新点软件	25,884,268.40	7.03
90	300443	金雷股份	24,645,191.00	6.69
91	002236	大华股份	24,367,608.36	6.62
92	300088	长信科技	24,291,289.02	6.60
93	688116	天奈科技	24,160,366.78	6.56
94	600971	恒源煤电	23,742,278.00	6.45
95	600491	龙元建设	23,516,657.00	6.39
96	000860	顺鑫农业	23,460,066.00	6.37
97	002271	东方雨虹	23,173,446.37	6.29
98	002391	长青股份	23,105,001.00	6.27
99	000001	平安银行	22,902,380.00	6.22
100	603180	金牌厨柜	22,889,877.93	6.22
101	601688	华泰证券	22,733,023.00	6.17
102	603297	永新光学	22,697,249.00	6.16
103	603662	柯力传感	22,496,855.88	6.11
104	605180	华生科技	22,162,044.11	6.02
105	688191	智洋创新	21,693,743.27	5.89
106	000977	浪潮信息	21,624,748.92	5.87

107	300394	天孚通信	21,306,107.30	5.79
108	600316	洪都航空	20,932,620.00	5.68
109	002206	海利得	20,798,171.00	5.65
110	300343	联创股份	20,746,393.94	5.63
111	300055	万邦达	20,709,128.00	5.62
112	300619	金银河	20,662,875.00	5.61
113	300705	九典制药	20,528,604.00	5.57
114	002867	周大生	20,413,132.54	5.54
115	300340	科恒股份	20,407,016.00	5.54
116	603583	捷昌驱动	20,386,725.00	5.54
117	002384	东山精密	20,253,635.29	5.50
118	002623	亚玛顿	19,841,581.00	5.39
119	600699	均胜电子	19,652,223.75	5.34
120	300354	东华测试	19,527,244.00	5.30
121	601288	农业银行	19,300,000.00	5.24
122	000568	泸州老窖	19,286,482.00	5.24
123	600010	包钢股份	19,274,728.00	5.23
124	603766	隆鑫通用	19,153,733.50	5.20
125	601678	滨化股份	19,023,050.01	5.17
126	603906	龙蟠科技	18,803,008.61	5.11
127	300041	回天新材	18,695,563.00	5.08
128	000681	视觉中国	18,569,411.24	5.04
129	688680	海优新材	18,504,419.40	5.02
130	300776	帝尔激光	18,480,004.10	5.02
131	600483	福能股份	18,392,103.84	4.99
132	603380	易德龙	18,269,860.24	4.96
133	600869	远东股份	18,188,534.69	4.94
134	002180	纳思达	17,995,489.00	4.89
135	002242	九阳股份	17,681,742.70	4.80
136	002597	金禾实业	17,501,442.00	4.75
137	603068	博通集成	17,497,567.00	4.75
138	600522	中天科技	17,464,517.50	4.74
139	002531	天顺风能	17,298,287.00	4.70
140	002967	广电计量	17,237,971.00	4.68
141	300900	广联航空	17,165,803.00	4.66
142	603198	迎驾贡酒	16,634,522.49	4.52

143	688002	睿创微纳	16,328,152.42	4.43
144	600597	光明乳业	16,300,125.10	4.43
145	600479	千金药业	16,221,574.68	4.40
146	603355	莱克电气	16,163,935.00	4.39
147	300693	盛弘股份	15,798,922.00	4.29
148	002056	横店东磁	15,748,051.12	4.28
149	601669	中国电建	15,718,403.00	4.27
150	300447	全信股份	15,693,743.00	4.26
151	601827	三峰环境	15,656,568.00	4.25
152	600031	三一重工	15,444,443.96	4.19
153	003021	兆威机电	15,441,557.86	4.19
154	300610	晨化股份	15,358,550.70	4.17
155	600163	中闽能源	15,308,291.00	4.16
156	002044	美年健康	15,014,126.00	4.08
157	300543	朗科智能	14,741,286.38	4.00
158	002004	华邦健康	14,669,524.00	3.98
159	300358	楚天科技	14,524,853.00	3.94
160	300382	斯莱克	14,507,810.57	3.94
161	688195	腾景科技	14,361,082.53	3.90
162	300416	苏试试验	14,316,714.00	3.89
163	000519	中兵红箭	14,302,112.49	3.88
164	000333	美的集团	14,206,572.00	3.86
165	603444	吉比特	14,190,393.00	3.85
166	300613	富瀚微	14,158,100.01	3.84
167	601600	中国铝业	14,013,243.68	3.80
168	601918	新集能源	13,987,471.00	3.80
169	601388	怡球资源	13,751,524.40	3.73
170	688981	中芯国际	13,592,876.21	3.69
171	300491	通合科技	13,562,392.40	3.68
172	300294	博雅生物	13,464,836.63	3.66
173	002402	和而泰	13,443,466.00	3.65
174	688776	国光电气	13,142,663.80	3.57
175	300770	新媒股份	12,951,404.60	3.52
176	300001	特锐德	12,828,769.00	3.48
177	002101	广东鸿图	12,736,478.50	3.46
178	603308	应流股份	12,625,043.60	3.43

179	300513	恒实科技	12,243,811.00	3.32
180	300809	华辰装备	12,243,621.14	3.32
181	688179	阿拉丁	12,211,735.90	3.32
182	600059	古越龙山	12,190,995.00	3.31
183	600685	中船防务	12,181,456.40	3.31
184	688369	致远互联	12,166,784.66	3.30
185	605166	聚合顺	11,951,112.00	3.25
186	01117	现代牧业	11,891,361.13	3.23
187	688059	华锐精密	11,839,890.91	3.21
188	605336	帅丰电器	11,741,913.04	3.19
189	300499	高澜股份	11,707,137.50	3.18
190	300073	当升科技	11,622,041.00	3.16
191	600893	航发动力	11,615,268.56	3.15
192	000848	承德露露	11,589,321.94	3.15
193	300825	阿尔特	11,447,650.00	3.11
194	601966	玲珑轮胎	11,352,149.45	3.08
195	000768	中航西飞	11,303,458.00	3.07
196	600338	西藏珠峰	11,281,978.00	3.06
197	600577	精达股份	11,261,001.00	3.06
198	300398	飞凯材料	11,118,777.65	3.02
199	300438	鹏辉能源	11,048,549.30	3.00
200	600328	中盐化工	11,030,431.00	3.00
201	603666	亿嘉和	11,008,000.20	2.99
202	601939	建设银行	11,005,982.00	2.99
203	002949	华阳国际	10,960,559.04	2.98
204	603489	八方股份	10,958,493.99	2.98
205	300616	尚品宅配	10,840,402.20	2.94
206	002084	海鸥住工	10,781,132.49	2.93
207	688333	铂力特	10,676,025.89	2.90
208	600063	皖维高新	10,668,182.73	2.90
209	688551	科威尔	10,612,106.01	2.88
210	603663	三祥新材	10,542,093.20	2.86
211	002918	蒙娜丽莎	10,286,540.00	2.79
212	300791	仙乐健康	10,278,084.67	2.79
213	603063	禾望电气	10,245,062.00	2.78
214	688005	容百科技	10,120,995.63	2.75

215	605399	晨光新材	10,108,386.00	2.74
216	600546	山煤国际	10,006,651.00	2.72
217	601398	工商银行	9,959,900.00	2.70
218	600285	羚锐制药	9,957,262.00	2.70
219	600888	新疆众和	9,956,031.91	2.70
220	000910	大亚圣象	9,942,771.70	2.70
221	600216	浙江医药	9,939,970.00	2.70
222	002538	司尔特	9,751,180.70	2.65
223	002136	安纳达	9,747,095.00	2.65
224	605369	拱东医疗	9,668,124.20	2.63
225	600990	四创电子	9,640,220.00	2.62
226	603776	永安行	9,587,178.40	2.60
227	002956	西麦食品	9,417,201.90	2.56
228	000650	仁和药业	9,410,267.82	2.56
229	300715	凯伦股份	9,354,933.00	2.54
230	002965	祥鑫科技	9,071,628.00	2.46
231	300232	洲明科技	9,038,326.36	2.45
232	002430	杭氧股份	8,751,551.87	2.38
233	688301	奕瑞科技	8,748,202.74	2.38
234	688518	联赢激光	8,721,255.97	2.37
235	603697	有友食品	8,717,772.08	2.37
236	603100	川仪股份	8,716,687.00	2.37
237	601339	百隆东方	8,697,864.00	2.36
238	600096	云天化	8,648,644.80	2.35
239	603818	曲美家居	8,572,959.00	2.33
240	000560	我爱我家	8,564,542.00	2.33
241	688698	伟创电气	8,513,749.62	2.31
242	300421	力星股份	8,491,107.00	2.31
243	603008	喜临门	8,426,393.21	2.29
244	600085	同仁堂	8,400,635.00	2.28
245	300158	振东制药	8,258,375.00	2.24
246	688071	华依科技	8,217,247.41	2.23
247	300935	盈建科	8,035,564.00	2.18
248	003011	海象新材	7,935,068.00	2.15
249	600600	青岛啤酒	7,790,707.70	2.12
250	300729	乐歌股份	7,709,861.40	2.09

251	603533	掌阅科技	7,423,745.32	2.02
252	688269	凯立新材	7,399,519.90	2.01

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

（2）“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002304	洋河股份	64,428,957.24	17.49
2	300911	亿田智能	63,670,257.74	17.29
3	688056	莱伯泰科	59,072,771.91	16.04
4	002318	久立特材	58,936,353.86	16.00
5	300035	中科电气	58,267,150.36	15.82
6	603801	志邦家居	56,773,290.42	15.42
7	002466	天齐锂业	54,511,281.75	14.80
8	300059	东方财富	54,098,769.05	14.69
9	603993	洛阳钼业	52,974,938.06	14.38
10	300203	聚光科技	52,439,881.29	14.24
11	000063	中兴通讯	51,362,778.86	13.95
12	300049	福瑞股份	50,284,586.84	13.65
13	688345	博力威	48,189,850.52	13.08
14	300813	泰林生物	46,452,237.00	12.61
15	300142	沃森生物	46,107,393.40	12.52
16	603606	东方电缆	43,578,323.11	11.83
17	000799	酒鬼酒	43,554,613.00	11.83
18	000938	紫光股份	42,472,455.40	11.53
19	603985	恒润股份	42,414,625.05	11.52
20	605305	中际联合	42,397,089.54	11.51
21	300922	天秦装备	42,294,948.44	11.48
22	300680	隆盛科技	41,767,432.53	11.34
23	002396	星网锐捷	40,930,609.00	11.11
24	300568	星源材质	39,842,481.85	10.82
25	600346	恒力石化	38,810,592.00	10.54
26	601615	明阳智能	37,890,998.56	10.29
27	002192	融捷股份	37,520,811.80	10.19
28	002568	百润股份	36,296,913.99	9.86
29	000301	东方盛虹	36,209,130.00	9.83

30	601658	邮储银行	35,870,972.00	9.74
31	688116	天奈科技	35,498,693.90	9.64
32	600436	片仔癀	34,993,350.28	9.50
33	301030	仕净科技	32,544,332.20	8.84
34	300193	佳士科技	32,543,191.00	8.84
35	000069	华侨城 A	32,426,157.74	8.80
36	600132	重庆啤酒	31,816,693.19	8.64
37	603369	今世缘	31,665,119.00	8.60
38	002013	中航机电	31,586,455.50	8.58
39	603883	老百姓	31,546,526.62	8.57
40	002149	西部材料	31,431,224.00	8.53
41	002933	新兴装备	31,380,800.49	8.52
42	000738	航发控制	31,200,714.82	8.47
43	000537	广宇发展	30,991,020.50	8.41
44	603218	日月股份	30,904,691.16	8.39
45	300036	超图软件	30,887,502.82	8.39
46	300443	金雷股份	30,720,919.00	8.34
47	002028	思源电气	30,622,279.00	8.31
48	605186	健麾信息	30,224,123.20	8.21
49	600862	中航高科	30,187,335.00	8.20
50	688033	天宜上佳	29,806,428.53	8.09
51	002614	奥佳华	29,706,073.08	8.07
52	300619	金银河	29,614,270.00	8.04
53	002240	盛新锂能	28,958,529.80	7.86
54	688408	中信博	28,871,573.24	7.84
55	002475	立讯精密	28,216,729.88	7.66
56	300233	金城医药	27,296,730.00	7.41
57	002373	千方科技	27,025,476.55	7.34
58	603330	上海天洋	26,844,566.98	7.29
59	000625	长安汽车	26,491,687.20	7.19
60	603180	金牌厨柜	25,702,387.98	6.98
61	600521	华海药业	25,222,615.90	6.85
62	002154	报喜鸟	25,022,133.00	6.79
63	002829	星网宇达	24,903,458.00	6.76
64	605180	华生科技	24,882,717.28	6.76
65	600821	金开新能	24,454,080.00	6.64
66	300343	联创股份	24,381,239.00	6.62
67	600491	龙元建设	24,327,410.50	6.61

68	603806	福斯特	23,989,837.78	6.51
69	002687	乔治白	23,908,285.00	6.49
70	603198	迎驾贡酒	23,664,023.80	6.43
71	002027	分众传媒	23,339,290.60	6.34
72	605099	共创草坪	23,103,126.00	6.27
73	002236	大华股份	22,837,443.00	6.20
74	300340	科恒股份	22,830,401.80	6.20
75	603297	永新光学	22,690,871.00	6.16
76	600971	恒源煤电	22,391,948.54	6.08
77	603380	易德龙	22,391,807.82	6.08
78	002664	长鹰信质	22,144,425.00	6.01
79	000977	浪潮信息	22,110,614.42	6.00
80	300055	万邦达	22,024,061.52	5.98
81	601688	华泰证券	21,677,528.00	5.89
82	002206	海利得	21,575,299.00	5.86
83	603662	柯力传感	21,266,025.95	5.77
84	000001	平安银行	21,258,031.00	5.77
85	002531	天顺风能	20,145,375.00	5.47
86	603583	捷昌驱动	19,962,971.56	5.42
87	600522	中天科技	19,810,382.37	5.38
88	300705	九典制药	19,550,818.05	5.31
89	600010	包钢股份	19,514,863.00	5.30
90	603444	吉比特	19,305,896.55	5.24
91	600483	福能股份	19,295,547.81	5.24
92	601288	农业银行	19,230,000.00	5.22
93	003021	兆威机电	19,114,636.70	5.19
94	600699	均胜电子	19,022,606.00	5.17
95	600316	洪都航空	18,926,665.02	5.14
96	300394	天孚通信	18,778,211.32	5.10
97	603906	龙蟠科技	18,680,133.00	5.07
98	002180	纳思达	18,484,442.80	5.02
99	002597	金禾实业	18,467,169.31	5.01
100	688059	华锐精密	18,459,549.35	5.01
101	000681	视觉中国	18,437,802.00	5.01
102	000860	顺鑫农业	18,342,687.12	4.98
103	002867	周大生	18,218,278.88	4.95
104	002623	亚玛顿	17,814,872.58	4.84
105	600869	远东股份	17,699,581.00	4.81



106	002056	横店东磁	17,319,814.94	4.70
107	603489	八方股份	17,318,013.00	4.70
108	300613	富瀚微	17,270,409.22	4.69
109	603766	隆鑫通用	17,261,578.83	4.69
110	601678	滨化股份	17,165,200.98	4.66
111	300776	帝尔激光	16,980,120.00	4.61
112	300354	东华测试	16,699,400.00	4.53
113	601388	怡球资源	16,489,012.92	4.48
114	688680	海优新材	16,351,940.27	4.44
115	600163	中闽能源	16,344,921.00	4.44
116	601827	三峰环境	16,319,876.00	4.43
117	000568	泸州老窖	16,194,664.00	4.40
118	603355	莱克电气	16,143,069.00	4.38
119	002967	广电计量	16,016,510.00	4.35
120	000848	承德露露	15,997,355.54	4.34
121	603068	博通集成	15,828,416.50	4.30
122	300900	广联航空	15,771,723.00	4.28
123	688002	睿创微纳	15,668,922.18	4.25
124	300693	盛弘股份	15,645,182.00	4.25
125	000333	美的集团	15,608,499.38	4.24
126	002242	九阳股份	15,569,644.88	4.23
127	600519	贵州茅台	15,527,050.50	4.22
128	688333	铂力特	15,462,754.88	4.20
129	300382	斯莱克	15,050,537.00	4.09
130	601669	中国电建	14,957,575.28	4.06
131	688551	科威尔	14,938,642.03	4.06
132	000519	中兵红箭	14,909,670.00	4.05
133	002044	美年健康	14,867,338.60	4.04
134	300294	博雅生物	14,765,767.00	4.01
135	300785	值得买	14,683,505.12	3.99
136	601918	新集能源	14,669,996.00	3.98
137	600031	三一重工	14,610,755.00	3.97
138	600597	光明乳业	14,568,736.60	3.96
139	002454	松芝股份	14,476,515.50	3.93
140	300447	全信股份	14,301,791.20	3.88
141	688981	中芯国际	14,010,195.78	3.80
142	300543	朗科智能	13,901,128.49	3.77
143	603008	喜临门	13,879,938.70	3.77

144	601600	中国铝业	13,782,827.50	3.74
145	300416	苏试试验	13,746,144.55	3.73
146	603639	海利尔	13,711,108.34	3.72
147	002004	华邦健康	13,443,280.89	3.65
148	603666	亿嘉和	13,341,525.60	3.62
149	300809	华辰装备	13,149,539.26	3.57
150	688776	国光电气	12,983,030.02	3.53
151	00700	腾讯控股	12,973,103.06	3.52
152	688195	腾景科技	12,779,254.50	3.47
153	605166	聚合顺	12,667,604.54	3.44
154	300513	恒实科技	12,656,469.92	3.44
155	600893	航发动力	12,609,948.40	3.42
156	601966	玲珑轮胎	12,601,778.50	3.42
157	688301	奕瑞科技	12,596,185.79	3.42
158	300616	尚品宅配	12,537,065.00	3.40
159	300770	新媒股份	12,434,577.00	3.38
160	002101	广东鸿图	12,426,116.41	3.37
161	603109	神驰机电	12,387,948.50	3.36
162	600085	同仁堂	12,294,581.42	3.34
163	600577	精达股份	12,185,919.20	3.31
164	002139	拓邦股份	12,109,839.40	3.29
165	002918	蒙娜丽莎	12,040,226.00	3.27
166	688369	致远互联	11,842,646.34	3.22
167	688518	联赢激光	11,741,080.79	3.19
168	300073	当升科技	11,571,256.01	3.14
169	600059	古越龙山	11,533,382.43	3.13
170	600685	中船防务	11,477,796.43	3.12
171	603663	三祥新材	11,421,810.66	3.10
172	300001	特锐德	11,388,424.72	3.09
173	600338	西藏珠峰	11,371,244.00	3.09
174	605336	帅丰电器	11,354,485.80	3.08
175	300438	鹏辉能源	11,120,679.90	3.02
176	603308	应流股份	11,000,770.98	2.99
177	300825	阿尔特	10,901,360.00	2.96
178	01117	现代牧业	10,869,472.75	2.95
179	002136	安纳达	10,787,404.00	2.93
180	600096	云天化	10,600,571.00	2.88
181	300499	高澜股份	10,540,512.54	2.86

182	603063	禾望电气	10,496,894.92	2.85
183	601939	建设银行	10,483,054.00	2.85
184	000650	仁和药业	10,465,446.86	2.84
185	300398	飞凯材料	10,445,057.70	2.84
186	600063	皖维高新	10,412,744.00	2.83
187	600328	中盐化工	10,405,948.00	2.83
188	300715	凯伦股份	10,376,029.25	2.82
189	002084	海鸥住工	10,360,906.60	2.81
190	600285	羚锐制药	10,354,261.00	2.81
191	603100	川仪股份	10,302,558.20	2.80
192	003011	海象新材	10,287,215.00	2.79
193	300491	通合科技	10,260,435.00	2.79
194	300358	楚天科技	10,247,353.00	2.78
195	002949	华阳国际	10,238,115.00	2.78
196	601398	工商银行	10,140,000.00	2.75
197	688179	阿拉丁	9,982,839.06	2.71
198	000910	大亚圣象	9,852,438.04	2.68
199	300421	力星股份	9,788,592.00	2.66
200	605369	拱东医疗	9,773,513.80	2.65
201	000560	我爱我家	9,709,185.00	2.64
202	600888	新疆众和	9,671,321.81	2.63
203	688005	容百科技	9,605,580.72	2.61
204	600216	浙江医药	9,568,518.20	2.60
205	603776	永安行	9,559,496.60	2.60
206	002538	司尔特	9,423,941.00	2.56
207	300791	仙乐健康	9,351,244.00	2.54
208	600990	四创电子	9,253,863.00	2.51
209	600733	北汽蓝谷	9,147,261.00	2.48
210	605399	晨光新材	9,061,696.00	2.46
211	002965	祥鑫科技	9,029,233.64	2.45
212	601339	百隆东方	8,985,418.00	2.44
213	002956	西麦食品	8,896,793.01	2.42
214	300232	洲明科技	8,831,490.92	2.40
215	002430	杭氧股份	8,817,096.00	2.39
216	688698	伟创电气	8,811,018.44	2.39
217	600546	山煤国际	8,686,504.00	2.36
218	603901	永创智能	8,549,757.50	2.32
219	603697	有友食品	8,523,818.53	2.31

220	300033	同花顺	8,428,401.00	2.29
221	688071	华依科技	8,427,088.13	2.29
222	603818	曲美家居	8,240,127.00	2.24
223	603678	火炬电子	8,024,143.43	2.18
224	603565	中谷物流	7,957,718.29	2.16
225	300158	振东制药	7,931,222.00	2.15
226	600600	青岛啤酒	7,870,019.00	2.14
227	603113	金能科技	7,580,461.40	2.06
228	002937	兴瑞科技	7,494,645.44	2.03
229	688257	新锐股份	7,450,355.00	2.02

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

（2）“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,077,682,867.84
卖出股票收入（成交）总额	5,121,809,579.53

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

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,777,607.92	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,777,607.92	0.21

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	13,210	1,321,000.00	0.10
2	127046	百润转债	9,038	1,240,375.12	0.09
3	118002	天合转债	1,220	216,232.80	0.02

**8.7 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

腾讯控股有限公司因未及时披露公司重大事项等行为在本报告编制前一年内受到国家市场监督管理总局的处罚。

基金投资上述主体相关证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。

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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	706,323.88

2	应收证券清算款	1,722,076.13
3	应收股利	-
4	应收利息	3,912.27
5	应收申购款	1,581,006.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,013,319.18

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002991	甘源食品	7,733,376.00	0.57	大宗交易流通受限

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
泰康品质生活混合 A	7,822	68,510.80	225,734,197.62	42.12%	310,157,262.75	57.88%
泰康品质生活混合 C	20,019	22,029.98	126,870,326.14	28.77%	314,147,927.42	71.23%
合计	27,364	35,700.55	352,604,523.76	36.09%	624,305,190.17	63.91%

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）。

### 9.2 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	泰康品质生活混合 A	9,093,121.40	1.6968%
	泰康品质生活混合 C	1,104,299.05	0.2504%
	合计	10,197,420.45	1.0438%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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有本开放式基金	泰康品质生活混合 A	>100
	泰康品质生活混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康品质生活混合 A	>100
	泰康品质生活混合 C	0
	合计	>100





## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康品质生活混合 A	泰康品质生活混合 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 30 日）基金份额总额	260,428,860.55	107,278,073.95
本报告期期初基金份额总额	260,428,860.55	107,278,073.95
本报告期基金总申购份额	521,775,659.47	492,392,688.04
减:本报告期基金总赎回份额	246,313,059.65	158,652,508.43
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	535,891,460.37	441,018,253.56

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

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人未出现重大人事变动。

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)报酬为 93,500.00 元；截至 2021 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 2 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	4	2,143,355,994.54	19.17%	578,332.75	19.12%	-
光大证券	4	2,052,859,858.74	18.36%	550,845.56	18.21%	-
天风证券	2	1,766,951,441.55	15.80%	479,292.14	15.84%	-
广发证券	2	1,655,355,395.40	14.80%	448,355.20	14.82%	-
东吴证券	2	1,167,420,365.49	10.44%	315,945.56	10.44%	-
国信证券	2	751,273,953.85	6.72%	203,326.98	6.72%	-
国盛证券	2	587,456,014.82	5.25%	160,752.93	5.31%	-

浙商证券	2	344,561,837.76	3.08%	94,212.64	3.11%	-
兴业证券	2	303,589,038.32	2.72%	82,089.30	2.71%	-
中信证券	3	259,587,983.63	2.32%	70,421.84	2.33%	-
中金公司	2	149,044,316.80	1.33%	41,320.75	1.37%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

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

## 2、交易单元的选择标准和程序

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 11 个交易单元，开源证券上海、深圳证券交易所交易单元各一个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各一个，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元各一个，中泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各一个，浙商证券上海、深圳证券交易所交易单元各一个，中信证券北京证券交易所交易单元一个。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	748,000,000.00	8.03%	-	-
光大证券	228,415.30	2.31%	873,000,000.00	9.37%	-	-
天风证券	1,579,871.42	15.94%	958,000,000.00	10.28%	-	-
广发证券	-	-	780,000,000.00	8.37%	-	-
东吴证券	-	-	345,000,000.00	3.70%	-	-
国信证券	8,100,960.00	81.75%	231,400,000.00	2.48%	-	-
国盛证券	-	-	4,870,000,000.00	52.26%	-	-
浙商证券	-	-	168,000,000.00	1.80%	-	-
兴业证券	-	-	166,000,000.00	1.78%	-	-
中信证券	-	-	130,000,000.00	1.39%	-	-
中金公司	-	-	50,000,000.00	0.54%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	关于泰康品质生活混合型证券投资基金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	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年3月25日
2	关于泰康品质生活混合型证券投资基金参加部分销售机构费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年3月25日
3	泰康品质生活混合型证券投资	《证券日报》、中国	2021年3月25日

	资基金开放日常申购;赎回;转换及定期定额投资业务公告	证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
4	泰康品质生活混合型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入及定投)业务公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年6月22日
5	泰康品质生活混合型证券投资基金恢复直销销售机构大额申购(含转换转入及定投)业务公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年7月16日
6	泰康品质生活混合型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入及定投)业务公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年8月4日
7	泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分基金在直销渠道最低申购金额;追加申购最低金额;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	2021年8月13日
8	泰康品质生活混合型证券投资基金暂停直销销售机构大额申购(含转换转入及定投)业务公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年9月7日
9	关于直销电子交易平台开展汇款交易;赎回转认购业务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	2021年1月21日
10	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商银行招赢通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	2021年1月22日
11	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度小满基金销售有限公司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	2021年1月22日
12	关于泰康资产管理有限责任	《中国证券报》、《上	2021年1月29日

	公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司定投费率优惠活动的公告	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	
13	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增中国中金财富证券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	2021年2月8日
14	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商银行招赢通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	2021年3月2日
15	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增腾安基金销售(深圳)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	2021年3月12日
16	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京度小满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	2021年3月16日
17	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珠海盈米基金销售有限公司最低申购金额;追加申购最低金额;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	2021年3月19日
18	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增光大证券股份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	2021年4月26日
19	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济安财富(北京)基金销	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、	2021年4月30日

	售有限公司最低申购金额;追加申购最低金额;赎回最低份额和持有最低限额的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
20	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海万得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	2021年5月10日
21	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“香港佛诞日”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《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	2021年5月17日
22	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京度小满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	2021年5月18日
23	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金开通在北京植信基金销售有限公司定投及转换业务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	2021年5月21日
24	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增通华财富(上海)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	2021年6月8日
25	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增光大证券股份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	2021年6月15日
26	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增中泰证券股份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	2021年6月17日

		管理人网站	
27	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海万得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	2021年6月18日
28	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京恒天明泽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	2021年6月28日
29	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行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	2021年6月30日
30	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海利得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	2021年7月12日
31	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增中信建投证券股份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	2021年7月15日
32	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北京新浪仓石基金销售有限公司最低申购金额;追加申购最低金额;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	2021年7月21日
33	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天风证券股份有限公司最低申购金额;追加申购最低金额;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	2021年7月21日
34	关于泰康资产管理有限责任	《中国证券报》、《上	2021年7月26日



	公司旗下部分开放式基金新增腾安基金销售(深圳)有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	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	
35	关于旗下基金开展直销电子交易系统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	2021年7月30日
36	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上海浦东发展银行股份有限公司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	2021年7月30日
37	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海万得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	2021年8月4日
38	关于直销电子交易系统开通赎回转申购业务并开展相关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	2021年8月6日
39	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增泰信财富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	2021年8月12日
40	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司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	2021年9月2日
41	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商证券股份有限公司为	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、	2021年9月3日

	销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
42	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京创金启富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	2021年9月6日
43	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商银行招赢通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	2021年9月7日
44	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海天天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	2021年9月10日
45	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上海基煜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	2021年9月27日
46	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京创金启富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	2021年9月30日
47	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信证券华南股份有限公司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	2021年10月15日
48	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增宜信普泽（北京）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	2021年10月22日

		管理人网站	
49	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海利得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	2021 年 10 月 28 日
50	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金开通在泰信财富基金销售有限公司定投及转换业务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	2021 年 11 月 18 日
51	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京度小满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	2021 年 11 月 19 日
52	泰康资产管理有限责任公司关于旗下部分公募基金可投资北交所股票的公告	《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	2021 年 11 月 20 日
53	关于直销电子交易系统开通赎回转申购业务并开展相关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	2021 年 11 月 23 日
54	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国信证券股份有限公司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	2021 年 11 月 26 日
55	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宜信普泽（北京）基金销售有限公司最低申购金额；追加申购最低金额；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	2021 年 12 月 29 日
56	关于泰康资产管理有限责任	《中国证券报》、《上	2021 年 12 月 31 日

	公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	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	
--	----------------------------------	---	--

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康品质生活混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康品质生活混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康品质生活混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康品质生活混合型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康品质生活混合型证券投资基金产品资料概要》。

### 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《证券日报》）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

2022年3月31日