

泰康恒泰回报灵活配置混合型
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
§5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
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.....	22
§6 审计报告	23
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
§7 年度财务报表	26
7.1 资产负债表.....	26
7.2 利润表.....	27
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	28
7.4 报表附注.....	29
§8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况.....	64
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	64
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.....	65
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71
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.....	72

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	72
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	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	75
§ 10 开放式基金份额变动	77
§ 11 重大事件揭示	78
11.1 基金份额持有人大会决议	78
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	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
11.4 基金投资策略的改变	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
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	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	79
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	87
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	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	87
§ 13 备查文件目录	88
13.1 备查文件目录	88
13.2 存放地点	88
13.3 查阅方式	88

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	泰康恒泰回报混合	
基金主代码	002934	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 13 日	
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,228,585,408.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C
下属分级基金的交易代码:	002934	002935
报告期末下属分级基金的份额总额	493,821,756.42 份	734,763,652.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在合理控制风险的基础上，通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动式组合管理获得超过业绩比较基准的收益。</p> <p>大类资产配置方面，本基金综合考虑宏观、政策、市场供求、投资价值比较、风险水平等因素，在股票与债券等资产类别之间进行动态资产配置。</p> <p>固定收益类投资方面，本基金通过分析宏观经济运行情况、判断经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。另外，本基金在分析各类债券资产的信用风险、流动性风险及其收益率水平的基础上，通过比较或合理预期各类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整优先配置的资产类别和配置比例。</p> <p>权益类投资方面，在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与权益类资产的投资，以增加基金收益。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，精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的上市公司股票进行投资。</p>
业绩比较基准	中债新综合财富（总值）指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*20%+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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光
	联系电话	010-58753683
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn
客户服务电话	4001895522	95559
传真	010-57818785	021-62701216
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	100033	200336
法定代表人	段国圣	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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		2019 年	
	泰康恒泰回 报混合 A	泰康恒泰回 报混合 C	泰康恒泰回 报混合 A	泰康恒泰回 报混合 C	泰康恒泰回 报混合 A	泰康恒泰回 报混合 C
本期已实现收益	39,572,977.06	42,148,046.63	39,500,219.75	15,368,274.73	8,758,838.22	12,072,961.53
本期利润	37,197,792.68	37,697,004.33	52,973,910.92	21,787,320.95	9,131,865.90	11,680,534.64
加权平均基金份额本期利润	0.1031	0.0927	0.2019	0.1709	0.0812	0.0863
本期加权平均	8.68%	7.46%	17.94%	14.61%	7.64%	7.75%

净值利润率						
本期基金份额净值增长率	9.44%	9.34%	16.15%	16.04%	7.54%	7.21%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	73,688,503.48	145,913,533.40	40,288,837.07	32,203,392.71	10,147,400.69	21,616,159.49
期末可供分配基金份额利润	0.1492	0.1986	0.1380	0.1881	0.1033	0.1533

期末基金资产净值	580,891,847 .53	901,677,140 .40	343,785,972 .27	210,513,290 .39	108,392,021 .95	162,595,941 .28
期末基金份额净值	1.1763	1.2272	1.1772	1.2293	1.1033	1.1533
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	52.49%	59.09%	39.34%	45.50%	19.96%	25.40%

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

泰康恒泰回报混合 A

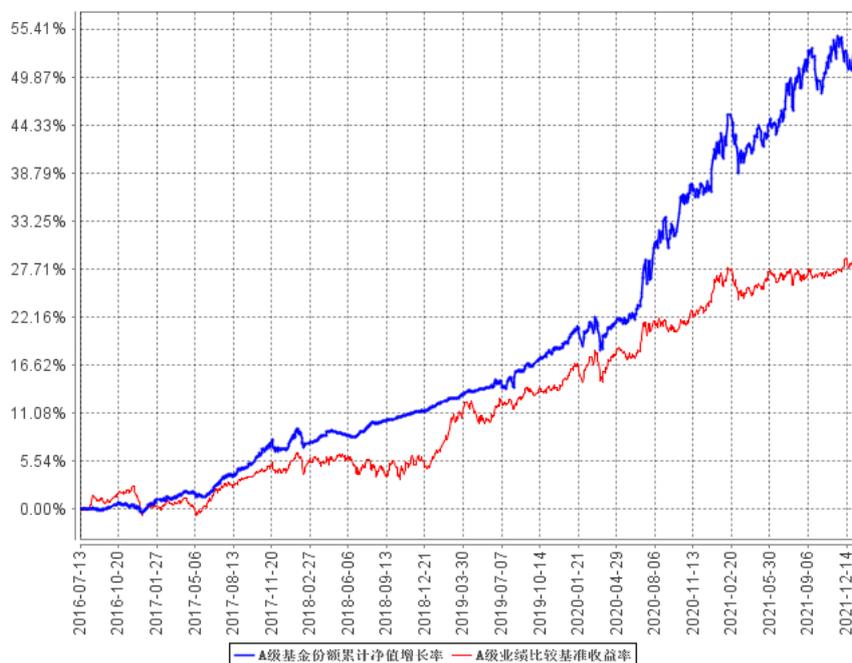
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.94%	0.41%	1.25%	0.16%	0.69%	0.25%
过去六个月	4.45%	0.47%	1.14%	0.21%	3.31%	0.26%
过去一年	9.44%	0.47%	2.98%	0.24%	6.46%	0.23%
过去三年	36.71%	0.37%	22.43%	0.25%	14.28%	0.12%
过去五年	52.40%	0.30%	28.32%	0.23%	24.08%	0.07%
自基金合同生效起至今	52.49%	0.29%	28.59%	0.23%	23.90%	0.06%

泰康恒泰回报混合 C

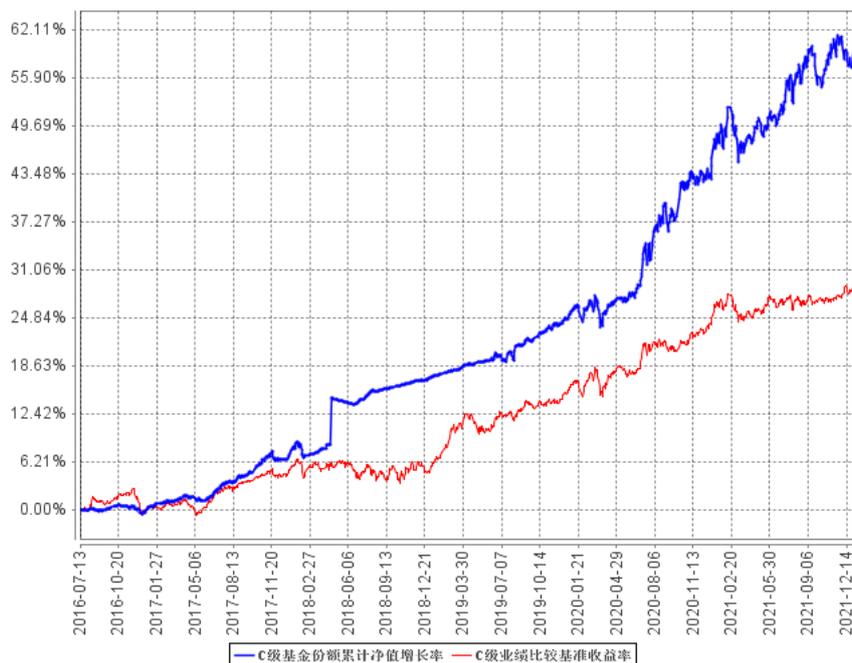
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.92%	0.41%	1.25%	0.16%	0.67%	0.25%
过去六个月	4.40%	0.47%	1.14%	0.21%	3.26%	0.26%
过去一年	9.34%	0.47%	2.98%	0.24%	6.36%	0.23%
过去三年	36.02%	0.37%	22.43%	0.25%	13.59%	0.12%
过去五年	59.23%	0.34%	28.32%	0.23%	30.91%	0.11%
自基金合同生效起至今	59.09%	0.32%	28.59%	0.23%	30.50%	0.09%

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

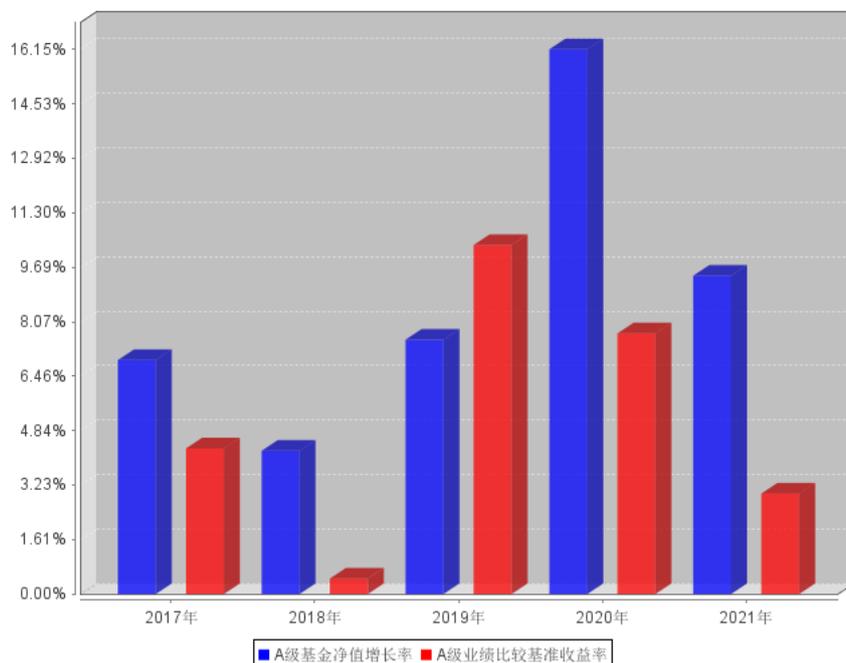


注：1、本基金基金合同于 2016 年 07 月 13 日生效。

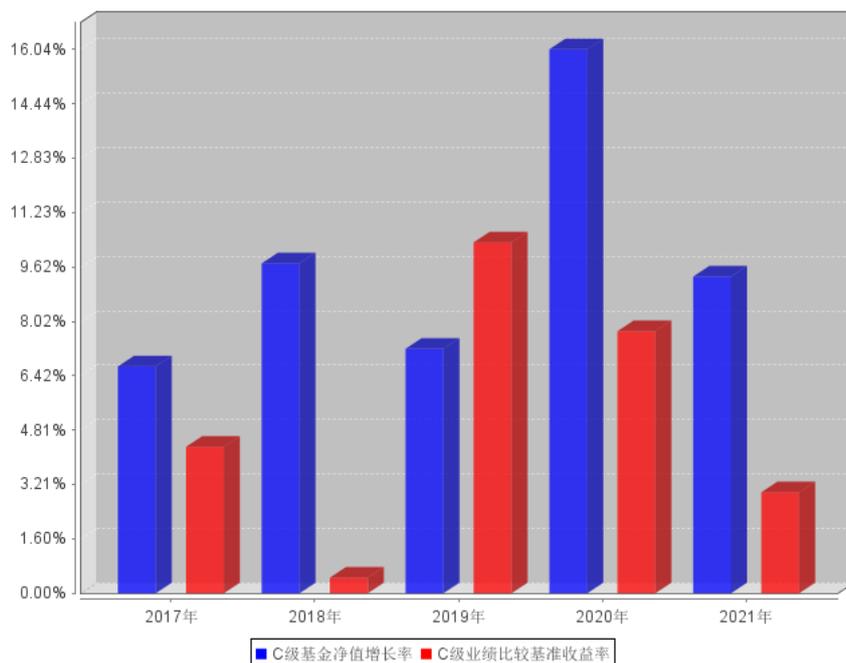
2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年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级过去五年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级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金成立于2016年07月13日,2016度净值增长率的计算期间为2016年07月13日至2016年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

泰康恒泰回报混合 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	1.0770	31,333,324.39	8,429,477.37	39,762,801.76	

2020	0.9320	18,940,527.26	3,321,852.69	22,262,379.95	
2019	-	-	-	-	
合计	2.0090	50,273,851.65	11,751,330.06	62,025,181.71	

单位：人民币元

泰康恒泰回报混合 C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	1.1240	21,751,944.05	28,627,374.93	50,379,318.98	
2020	0.9740	3,049,704.49	8,843,547.36	11,893,251.85	
2019	-	-	-	-	
合计	2.0980	24,801,648.54	37,470,922.29	62,272,570.83	

§ 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(FOF)、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		
任慧娟	本基金基金经理	2016 年 7 月 13 日	-	15	任慧娟于 2015 年 8 月加入泰康资产管理有限责任公司, 现担任公募事业部固定收益投资经理。2007 年 7 月至 2008 年 7 月在阳光财产保险公司资金运用部统计分析岗工作, 2008 年 7 月至 2011 年 1 月在阳光保险集团资产管理中心历任风险管理岗、债券研究岗, 2011 年 1 月起任固定收益投资经理, 至 2015 年 8 月在阳光资产管理公司固定收益部投资部任高级投资经

					理。2015 年 12 月 9 日至今担任泰康薪意保货币市场基金基金经理。2016 年 5 月 9 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 7 月 13 日至今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。2016 年 8 月 24 日至今担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 21 日至 2019 年 5 月 8 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 9 月 8 日至今担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康申润一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
金宏伟	本基金基金经理	2020 年 7 月 2 日	-	10	金宏伟于 2016 年 12 月加入泰康资产, 现任公募事业部投资部股票投资总监。2006 年 7 月至 2012 年 3 月曾任中钢集团工程总包项目经理、工程师、国际商务师。2012 年 3 月至 2016 年 12 月历任新华基金行业研究员、中上游行业组长、中游及 TMT 行业组长、研究部总监助理、专户投资部投资经理。2017 年 8 月

					28 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。2017 年 8 月 28 日至 2019 年 5 月 9 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。2020 年 7 月 2 日至今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。2020 年 7 月 24 日至今担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 10 日至今担任泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 7 日至今担任泰康裕泰债券型证券投资基金基金经理。
朱婕	本基金基金经理助理	2020 年 5 月 13 日	-	9	朱婕于 2015 年 4 月加入泰康资产, 现任公募事业部投资部股票投资高级经理。历任研究部股票研究员。2013 年至 2015 年在中国国际金融有限公司研究部担任分析师。2020 年 5 月 13 日至今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助理。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合

法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 年是经济内生动能逐步减缓的一年，经济从疫后的复苏期逐步进入到下行压力显性化的阶段。宏观政策的定调在结构性改革，GDP 由于基数原因达成目标的难度较小，宏观经济的长期改革得以有效推进。在年中前后逐步推行的诸如“三条红线”、“双碳”、“双减”等政策，有效地推进了经济中长期结构性问题的改革，但也给短期经济增长带来压力；叠加全年

疫情影响始终存在，经济下行压力逐步加大。21 年经济的亮点在于出口和制造业投资，中国制造的竞争优势在全球一枝独秀。物价方面，由于双碳的约束和海外供给共振，PPI 一路上行，但 CPI 表现疲弱。

债券市场方面，2021 年收益率呈现了震荡下行的走势。年初由于经济动能仍强、阶段性的资金收敛曾一度推高了收益率，但随时资产荒压力逐步显现，社融下行，经济压力逐步加大，收益率震荡下行，7 月份的降准则将收益率中枢明显下移。此后，收益率尽管有所波折，但总体趋势仍然向下，12 月的再次降准和 1Y LPR 下调也彰显了货币政策呵护实体经济的决心。全年来看，10Y 国债下行 37bp，中短端得益于流动性宽松下行幅度更大。

权益市场方面，春节之后受到美债利率大幅上行等因素的影响，风险偏好显著下降，股票市场经历了较大幅调整，部分优质成长股在经历了前期下跌之后已经到了可以获得合意回报的区间。进入 2 季度，市场对全年经济强复苏的预期有所降温，投资、消费和金融数据都指向需求边际走弱，大宗商品涨幅也在 2 季度放缓，风险偏好在本期显著回升。3 季度，消费、地产、基建、信贷等数据逐月低于预期，确认我国经济动能趋缓；制造业投资回暖是为数不多的亮点，但上游资源涨价和短缺对中游制造业构成了阶段性冲击。4 季度，随着经济从“内外需双强”转为“外需单强”的格局，局部增长的亮点仍存，对应权益市场仍有结构性的机会。从大盘和板块上来看，上证综指上涨 4.8%，沪深 300 下跌 5.2%，中小板指下跌 4.62%，创业板指上涨 12.02%。其中，电力设备及新能源、基础化工、有色金属等板块表现相对较好，家电、非银行金融、消费者服务等行业表现不佳。

固收投资方面，本基金在报告期内以获取持有期收益为主要目标，在控制组合久期水平的基础上，维持比较高的信用债配置比例和适度的杠杆水平。信用债方面，精挑细选优质主体，严防信用尾部风险。

权益投资方面，基金在仓位上相机而动，不超过 30%。分季度看，一季度，增加了科技股和金融股的配置，降低了消费股的持仓，整体持仓以金融、高端制造、生物医药、建材、新能源车等行业为主，适当配置品牌消费品；二季度，配置以新材料、高端制造、生物医药、新能源车、银行行业为主，适当配置品牌消费品。三季度，配置思路有所变化，以生物医药、高端制造、新材料、新能源车和非银金融等行业为主，适当配置品牌消费品。四季度，配置以高端制造、生物医药、新材料、新能源车、非银金融、家电行业为主，适当配置品牌消费品。全年注重配置远大发展空间的医药和科技板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康恒泰回报 A 基金份额净值为 1.1763 元，本报告期基金份额净值增长率为

9.44%；截至本报告期末泰康恒泰回报 C 基金份额净值为 1.2272 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.34%；同期业绩比较基准增长率为 2.98%。

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。

对于债券市场，最大的背景是经济的恢复离不开货币政策的支持，因此总体上较难出现非常大的调整。但房地产边际放松可能会增加社融回升的持续性，叠加估值一般，市场可能某些时候会出现一定逆风，但调整之后将会达到更为健康的状态。信用债市场的分化预计持续，民营房企的风险暴露过程需要重点关注，精选个券是主要思路。

对于权益市场，21 年 12 月中央经济工作会议以来，有远大成长空间的高估值板块集体杀跌，低估值板块表现相对较优。展望未来，我们依然对股票市场的中长期持乐观态度，主要因为目前股市整体估值处于历史均值附近，流动性趋于宽松，权益资产还是各大类资产中风险收益比最高的资产，而且从中长期看，政府对经济和股市的政策支持将成为常态。短期来看，我们认为市场仍处于弱势震荡格局，一方面宏观流动性趋于宽松和当前市场流动性因为前期快速下跌带来收缩相互作用；另一方面经济下行的背景下，稳经济的政策对实体经济起作用需要时间，同时疫情并未完全结束，国际关系趋于紧张，高估值板块快速下跌带来的情绪影响也需要时间消化，市场在这些正负因素的影响下处于弱平衡状态，整体呈现震荡格局。展望 2022 年，将继续以权益底仓+积极参与新股申购的策略运作，权益仓位不超过 30%，重点关注优质赛道龙头公司、新能源、新能源车产业链、其他有比较竞争优势高成长的中国制造、传统能源、品牌消费品、生物医药等行业，均衡策略。

我们将紧密跟踪经济和市场的动态变化，力争把握机会、规避风险，为基金持有人取得较好回报。

4.6 管理人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

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，泰康恒泰回报混合 A 实施利润分配的金额为 39,762,801.76 元，泰康恒泰回报混合 C 实施利润分配的金额为 50,379,318.98 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

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

本报告期内，基金托管人在泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，泰康资产管理有限责任公司在泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由泰康资产管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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 20990 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	泰康恒泰回报灵活配置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>我们审计了泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“泰康恒泰回报混合”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度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,公允反映了泰康恒泰回报混合 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度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,我们独立于泰康恒泰回报混合,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	<p>泰康恒泰回报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恒泰回报混合</p>

	<p>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恒泰回报混合、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恒泰回报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,就可能导致对泰康恒泰回报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恒泰回报混合不能持续经营。</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：泰康恒泰回报灵活配置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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,704,176.57	475,546.92
结算备付金		6,751,244.40	4,187,552.49
存出保证金		320,856.00	206,286.31
交易性金融资产	7.4.7.2	1,993,674,856.30	668,448,831.91
其中：股票投资		415,373,366.98	165,624,350.45
基金投资		-	-
债券投资		1,578,301,489.32	502,824,481.46
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	-	3,000,000.00
应收证券清算款		5,010,924.08	5,007,718.04
应收利息	7.4.7.5	26,090,768.39	9,846,363.44
应收股利		-	-
应收申购款		408,388.53	113,388.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,034,961,214.27	691,285,687.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
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		514,198,570.45	130,499,177.25
应付证券清算款		7,026,260.21	5,221,027.82
应付赎回款		29,318,651.63	534,009.94
应付管理人报酬		749,724.69	312,439.88
应付托管费		124,954.09	52,073.31
应付销售服务费		73,967.71	17,627.22
应付交易费用	7.4.7.7	416,583.30	181,200.10
应交税费		126,218.28	54,626.21
应付利息		263,223.12	40,231.50

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	94,072.86	74,011.93
负债合计		552,392,226.34	136,986,425.16
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,228,585,408.49	463,275,537.45
未分配利润	7.4.7.10	253,983,579.44	91,023,725.21
所有者权益合计		1,482,568,987.93	554,299,262.66
负债和所有者权益总计		2,034,961,214.27	691,285,687.82

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，泰康恒泰回报混合 A 基金份额净值 1.1763 元，基金份额总额 493,821,756.42 份；泰康恒泰回报混合 C 基金份额净值 1.2272 元，基金份额总额 734,763,652.07 份。泰康恒泰回报混合份额总额合计为 1,228,585,408.49 份。

7.2 利润表

会计主体：泰康恒泰回报灵活配置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 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		90,874,064.13	81,363,049.59
1.利息收入		34,329,962.24	15,614,196.23
其中：存款利息收入	7.4.7.11	105,433.25	71,348.18
债券利息收入		34,136,694.80	15,537,430.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		87,834.19	5,417.97
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		63,217,008.00	45,576,202.20
其中：股票投资收益	7.4.7.12	52,319,877.56	43,393,880.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	9,532,507.50	221,200.04
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	1,364,622.94	1,961,121.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-6,826,226.68	19,892,737.39
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	153,320.57	279,913.77

列)			
减：二、费用		15,979,267.12	6,601,817.72
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,569,177.00	2,643,066.98
2. 托管费	7.4.10.2.2	928,196.05	440,511.13
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	501,847.04	149,216.93
4. 交易费用	7.4.7.19	3,459,552.54	1,404,520.70
5. 利息支出		5,147,941.72	1,676,090.82
其中：卖出回购金融资产支出		5,147,941.72	1,676,090.82
6. 税金及附加		114,974.45	53,419.64
7. 其他费用	7.4.7.20	257,578.32	234,991.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		74,894,797.01	74,761,231.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		74,894,797.01	74,761,231.87

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康恒泰回报灵活配置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）	463,275,537.45	91,023,725.21	554,299,262.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	74,894,797.01	74,894,797.01
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）	765,309,871.04	178,207,177.96	943,517,049.00
其中：1. 基金申购款	1,048,462,356.67	239,375,406.12	1,287,837,762.79
2. 基金赎回款	-283,152,485.63	-61,168,228.16	-344,320,713.79
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）	-	-90,142,120.74	-90,142,120.74
五、期末所有者权益（基	1,228,585,408.49	253,983,579.44	1,482,568,987.93

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	239,224,403.05	31,763,560.18	270,987,963.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	74,761,231.87	74,761,231.87
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）	224,051,134.40	18,654,564.96	242,705,699.36
其中：1. 基金申购款	509,011,629.76	59,309,883.64	568,321,513.40
2. 基金赎回款	-284,960,495.36	-40,655,318.68	-325,615,814.04
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）	-	-34,155,631.80	-34,155,631.80
五、期末所有者权益（基金净值）	463,275,537.45	91,023,725.21	554,299,262.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1262号《关于准予泰康恒泰回报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《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币502,345,524.74元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第897号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年7月13日正

式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 502,355,699.92 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,175.18 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，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《泰康恒泰回报灵活配置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。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、权证、股指期货等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购等)、银行存款(包括协议存款、定期存款)、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中债新综合财富(总值)指数收益率 \times 75%+沪深 300 指数收益率 \times 20%+金融机构人民币活期存款利率(税后) \times 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》、《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的

有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度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。

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	2,704,176.57	475,546.92
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：	2,704,176.57	475,546.92

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	406,386,722.77	415,373,366.98	8,986,644.21	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	417,267,740.54	417,653,689.32	385,948.78
	银行间市场	1,156,538,726.31	1,160,647,800.00	4,109,073.69
	合计	1,573,806,466.85	1,578,301,489.32	4,495,022.47
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,980,193,189.62	1,993,674,856.30	13,481,666.68	
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	141,371,254.95	165,624,350.45	24,253,095.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	123,371,598.69	122,034,581.46	-1,337,017.23
	银行间市场	383,398,084.91	380,789,900.00	-2,608,184.91
	合计	506,769,683.60	502,824,481.46	-3,945,202.14
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	648,140,938.55	668,448,831.91	20,307,893.36
----	----------------	----------------	---------------

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	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
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	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	-

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	129.63	100.44
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	3,341.80	2,072.84
应收债券利息	26,086,272.56	9,844,085.85
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	865.56	2.12
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	158.84	102.19

合计	26,090,768.39	9,846,363.44
----	---------------	--------------

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	385,441.68	164,780.13
银行间市场应付交易费用	31,141.62	16,419.97
合计	416,583.30	181,200.10

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	72.86	11.93
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	94,000.00	74,000.00
合计	94,072.86	74,011.93

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰康恒泰回报混合 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	292,033,400.95	292,033,400.95
本期申购	292,427,898.80	292,427,898.80
本期赎回（以“-”号填列）	-90,639,543.33	-90,639,543.33
- 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	493,821,756.42	493,821,756.42

金额单位：人民币元

泰康恒泰回报混合 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	171,242,136.50	171,242,136.50
本期申购	756,034,457.87	756,034,457.87
本期赎回（以“-”号填列）	-192,512,942.30	-192,512,942.30
- 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	734,763,652.07	734,763,652.07

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰康恒泰回报混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,288,837.07	11,463,734.25	51,752,571.32
本期利润	39,572,977.06	-2,375,184.38	37,197,792.68
本期基金份额交易产生的变动数	33,589,491.11	4,293,037.76	37,882,528.87
其中：基金申购款	46,644,619.08	7,276,461.55	53,921,080.63
基金赎回款	-13,055,127.97	-2,983,423.79	-16,038,551.76
本期已分配利润	-39,762,801.76	-	-39,762,801.76
本期末	73,688,503.48	13,381,587.63	87,070,091.11

单位：人民币元

泰康恒泰回报混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,203,392.71	7,067,761.18	39,271,153.89
本期利润	42,148,046.63	-4,451,042.30	37,697,004.33
本期基金份额交易产生的变动数	121,941,413.04	18,383,236.05	140,324,649.09
其中：基金申购款	161,513,542.65	23,940,782.84	185,454,325.49
基金赎回款	-39,572,129.61	-5,557,546.79	-45,129,676.40
本期已分配利润	-50,379,318.98	-	-50,379,318.98
本期末	145,913,533.40	20,999,954.93	166,913,488.33

7.4.7.11 存款利息收入

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1月1日至2020年12月31 日
活期存款利息收入	8,736.61	7,141.33
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	81,835.65	56,147.72
其他	14,860.99	8,059.13
合计	105,433.25	71,348.18

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 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
卖出股票成交总额	1,909,558,395.29	763,130,847.44
减：卖出股票成本总额	1,857,238,517.73	719,736,966.93
买卖股票差价收入	52,319,877.56	43,393,880.51

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1月1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	9,532,507.50	221,200.04
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	9,532,507.50	221,200.04

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	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年
----	----------------------	----------------------------

	年12月31日	12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,701,703,001.17	530,389,317.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,662,978,669.13	521,255,242.87
减：应收利息总额	29,191,824.54	8,912,874.93
买卖债券差价收入	9,532,507.50	221,200.04

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，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，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，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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,364,622.94	1,961,121.65
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	1,364,622.94	1,961,121.65

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-6,826,226.68	19,892,737.39
——股票投资	-15,266,451.29	24,178,653.85
——债券投资	8,440,224.61	-4,285,916.46
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-

——权证投资	-	-
期货投资	-	-
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	-6,826,226.68	19,892,737.39

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1月1日至2020年12 月31日
基金赎回费收入	135,558.97	274,424.87
其他	7,260.00	-
基金转换费收入	10,501.60	5,488.90
合计	153,320.57	279,913.77

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1月1日至2020年12 月31日
交易所市场交易费用	3,418,548.79	1,390,128.20
银行间市场交易费用	41,003.75	14,392.50
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	3,459,552.54	1,404,520.70

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1月1日至2020年 12月31日
审计费用	85,000.00	65,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	1,200.00	1,200.00
债券帐户维护费	36,000.00	36,000.00
银行费用	15,378.32	12,791.52
合计	257,578.32	234,991.52

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
交通银行股份有限公司	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，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1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,569,177.00	2,643,066.98
其中：支付销售机构的客户维护费	417,914.03	115,074.61

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 0.60% 的费率计提，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×0.60% / 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1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	928,196.05	440,511.13

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10% / 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		
	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C	合计
泰康资产管理有限责任公司	-	428,210.88	428,210.88
交通银行	-	193.96	193.96
合计	-	428,404.84	428,404.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C	合计
泰康资产管理有限责任公司	-	135,564.20	135,564.20
交通银行	-	67.25	67.25
合计	-	135,631.45	135,631.45

注：本基金 A 类基金份额不计提销售服务费，C 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰康资产管理有限责任公司，再由泰康资产管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.10%/ 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，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，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，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**

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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1月1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
交通银行	2,704,176.57	8,736.61	475,546.92	7,141.33

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

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，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，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

泰康恒泰回报混合A

金额单位：人民币元

序	除息日	每10份	现金形式	再投资形式	本期利润分配

号	权益 登记日	场内	场外	基金份额分 红 数	发放总额	发放总额	合计	备注
1	2021 年 11 月 25 日	-	2021 年 11 月 25 日	0.4910	16,693,217.35	7,486,586.62	24,179,803.97	
2	2021 年 3 月 15 日	-	2021 年 3 月 15 日	0.5860	14,640,107.04	942,890.75	15,582,997.79	
合计	-	-		1.0770	31,333,324.39	8,429,477.37	39,762,801.76	

泰康恒泰回报混合 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份 额分 红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 11 月 25 日	-	2021 年 11 月 25 日	0.5120	14,708,320.68	18,970,481.35	33,678,802.03	
2	2021 年 3 月 15 日	-	2021 年 3 月 15 日	0.6120	7,043,623.37	9,656,893.58	16,700,516.95	
合计	-	-		1.1240	21,751,944.05	28,627,374.93	50,379,318.98	

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 7 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	网下新股受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
688187	时代电气	2021 年 8 月 30 日	2022 年 3 月 7 日	新股限售	31.38	76.65	14,449	453,409.62	1,107,515.85	-
688167	炬光科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股限售	78.69	176.67	2,014	158,481.66	355,813.38	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股限售	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	新股限售	22.04	56.28	603	13,290.12	33,936.84	-
301090	华润材料	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 26 日	新股限售	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301127	天源环保	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	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	新锁定期通限	股 定 流 受	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	新锁定期通限	股 定 流 受	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	新锁定期通限	股 定 流 受	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	新锁定期通限	股 定 流 受	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	新锁定期通限	股 定 流 受	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	新锁定期通限	股 定 流 受	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新锁定期通限	股 定 流 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	新锁定期通限	股 定 流 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	新锁定期通	股 定 流 受	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-

				限							
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新锁定期	股 定 流 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	新锁定期	股 定 流 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	新锁定期	股 定 流 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	新锁定期	股 定 流 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	新锁定期	股 定 流 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20日	新锁定期	股 定 流 受	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	新锁定期	股 定 流 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	新锁定期	股 定 流 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	新锁定期	股 定 流	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-

			日	通 受						
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 转 债	2021 年 12 月 29 日	2022 年 1 月 14 日	网 下 新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	15,380	1,538,000.00	1,538,000.00	-

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份，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份不适用《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，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 339,698,570.45 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	--------	-------	--------

190207	19 国开 07	2022 年 1 月 4 日	100.32	300,000	30,096,000.00
012103700	21 津城建 SCP054	2022 年 1 月 5 日	100.16	52,000	5,208,320.00
200312	20 进出 12	2022 年 1 月 4 日	100.35	100,000	10,035,000.00
210211	21 国开 11	2022 年 1 月 4 日	99.91	100,000	9,991,000.00
102001365	20 河钢集 MTN007	2022 年 1 月 5 日	101.07	200,000	20,214,000.00
102001918	20 临空港 投 MTN002	2022 年 1 月 5 日	101.81	200,000	20,362,000.00
012103247	21 通顺交 投 SCP002	2022 年 1 月 5 日	100.48	100,000	10,048,000.00
150412	15 农发 12	2022 年 1 月 4 日	100.71	300,000	30,213,000.00
102101599	21 荣盛 MTN002	2022 年 1 月 4 日	100.92	100,000	10,092,000.00
012103749	21 粤珠江 SCP002	2022 年 1 月 4 日	100.35	200,000	20,070,000.00
210306	21 进出 06	2022 年 1 月 4 日	99.93	500,000	49,965,000.00
102002108	20 成华国 资 MTN001	2022 年 1 月 5 日	101.65	50,000	5,082,500.00
102100743	21 贵州高 速 MTN001	2022 年 1 月 4 日	102.02	100,000	10,202,000.00
012103041	21 通顺交 投 SCP001	2022 年 1 月 5 日	100.58	8,000	804,640.00
012103321	21 津城建 SCP045	2022 年 1 月 4 日	100.15	200,000	20,030,000.00
160404	16 农发 04	2022 年 1 月 4 日	100.93	500,000	50,465,000.00
102103131	21 衡阳城 投 MTN003	2022 年 1 月 5 日	100.39	200,000	20,078,000.00
012103010	21 津城建 SCP040	2022 年 1 月 5 日	100.42	200,000	20,084,000.00
012104093	21 粤珠江 SCP004	2022 年 1 月 4 日	100.18	27,000	2,704,860.00
101800180	18 河钢集 MTN002	2022 年 1 月 4 日	103.68	200,000	20,736,000.00
合计				3,637,000	366,481,320.00

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,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 174,500,000.00 元,于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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交通银行股份有限公司，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	30,144,000.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	235,628,500.00	0.00
合计	265,772,500.00	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	481,924,062.00	181,810,381.46
AAA 以下	554,164,427.32	288,101,200.00
未评级	95,675,500.00	0.00
合计	1,131,763,989.32	469,911,581.46

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 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。

7.4.13.3 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金及存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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	2,704,176.57	-	-	-	2,704,176.57
结算备付金	6,751,244.40	-	-	-	6,751,244.40
存出保证金	320,856.00	-	-	-	320,856.00
交易性金融资产	622,076,820.00	918,545,018.60	37,679,650.72	415,373,366.98	1,993,674,856.30
应收证券清算款	-	-	-	5,010,924.08	5,010,924.08
应收利息	-	-	-	26,090,768.39	26,090,768.39
应收申购款	6,100.00	-	-	402,288.53	408,388.53
资产总计	631,859,196.97	918,545,018.60	37,679,650.72	446,877,347.98	2,034,961,214.27
负债					
卖出回购金融资产款	514,198,570.45	-	-	-	514,198,570.45

应付证券清算款	-	-	-	7,026,260.21	7,026,260.21
应付赎回款	-	-	-	29,318,651.63	29,318,651.63
应付管理人报酬	-	-	-	749,724.69	749,724.69
应付托管费	-	-	-	124,954.09	124,954.09
应付销售服务费	-	-	-	73,967.71	73,967.71
应付交易费用	-	-	-	416,583.30	416,583.30
应付利息	-	-	-	263,223.12	263,223.12
应交税费	-	-	-	126,218.28	126,218.28
其他负债	-	-	-	94,072.86	94,072.86
负债总计	514,198,570.45	-	-	38,193,655.89	552,392,226.34
利率敏感度缺口	117,660,626.52	918,545,018.60	37,679,650.72	408,683,692.09	1,482,568,987.93
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	475,546.92	-	-	-	475,546.92
结算备付金	4,187,552.49	-	-	-	4,187,552.49
存出保证金	206,286.31	-	-	-	206,286.31
交易性金融资产	293,301,700.00	201,254,345.00	8,268,436.46	165,624,350.45	668,448,831.91
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	5,007,718.04	5,007,718.04
应收利息	-	-	-	9,846,363.44	9,846,363.44
应收申购款	30,000.00	-	-	83,388.71	113,388.71
资产总计	301,201,085.72	201,254,345.00	8,268,436.46	180,561,820.64	691,285,687.82
负债					
卖出回购金融资产 款	130,499,177.25	-	-	-	130,499,177.25
应付证券清算款	-	-	-	5,221,027.82	5,221,027.82
应付赎回款	-	-	-	534,009.94	534,009.94
应付管理人报酬	-	-	-	312,439.88	312,439.88
应付托管费	-	-	-	52,073.31	52,073.31
应付销售服务费	-	-	-	17,627.22	17,627.22
应付交易费用	-	-	-	181,200.10	181,200.10
应付利息	-	-	-	40,231.50	40,231.50
应交税费	-	-	-	54,626.21	54,626.21
其他负债	-	-	-	74,011.93	74,011.93
负债总计	130,499,177.25	-	-	6,487,247.91	136,986,425.16
利率敏感度缺口	170,701,908.47	201,254,345.00	8,268,436.46	174,074,572.73	554,299,262.66

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%	5,210,261.97	1,340,811.64
市场利率上调 0.25%	-5,169,396.40	-1,330,710.82	

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-95%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产—股票投资	415,373,366.98	28.02	165,624,350.45	29.88
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	415,373,366.98	28.02	165,624,350.45	29.88

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%	19,022,186.28	9,073,570.42
业绩比较基准中的权益指数下跌5%	-19,022,186.28	-9,073,570.42	

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473,327,736.43元，属于第二层次的余额为1,518,447,764.13元，属于第三层次的余额为1,899,355.74元。（2020年12月31日，属于第一层次的余额为179,798,821.55元，属于第二层次的余额为488,650,010.36元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动。

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 1,899,355.74 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 825,118.23 元，计入当期损益的利得或损失金额为 1,074,237.51 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 1,074,237.51 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) 本基金于 2021 年 12 月 13 日将持有的 100,000 张 19 津投 01 债券(代码: 155125)行使回售选择权，以 100.00 元/张的回售价格回售给发行人，截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，该部分债券因行使回售选择权而流通受限，回售资金于 2022 年 1 月 11 日到账。于 2021 年 12 月 24 日将持有的 100,000 张 19 津投 03 债券(代码: 155161)行使回售选择权，以 100.00 元/张的回售价格回售给发行人，截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，该部分债券因行使回售选择权而流通受限，回售资金于 2022 年 1 月 24 日到账。

(3) 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。

(4)除公允价值、回售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	415,373,366.98	20.41
	其中：股票	415,373,366.98	20.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,578,301,489.32	77.56
	其中：债券	1,578,301,489.32	77.56
	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	-	-
	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	9,455,420.97	0.46
8	其他各项资产	31,830,937.00	1.56
9	合计	2,034,961,214.27	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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	374,907,657.11	25.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,358,964.00	0.70
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	11,722,086.20	0.79
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	18,144,330.08	1.22
J	金融业	70,640.32	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	34,387.07	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	415,373,366.98	28.02

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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	002332	仙琚制药	2,837,300	37,452,360.00	2.53
2	002594	比亚迪	130,300	34,936,036.00	2.36
3	601865	福莱特	598,900	34,700,266.00	2.34
4	300680	隆盛科技	942,699	29,412,208.80	1.98
5	002409	雅克科技	343,500	27,881,895.00	1.88
6	603105	芯能科技	1,661,100	27,607,482.00	1.86
7	000333	美的集团	340,400	25,124,924.00	1.69
8	002906	华阳集团	352,600	19,378,896.00	1.31
9	000739	普洛药业	457,700	16,060,693.00	1.08
10	300014	亿纬锂能	134,700	15,918,846.00	1.07
11	300382	斯莱克	574,749	13,242,216.96	0.89
12	002727	一心堂	298,800	11,506,788.00	0.78
13	601012	隆基股份	128,500	11,076,700.00	0.75
14	600483	福能股份	636,300	10,358,964.00	0.70
15	300496	中科创达	67,500	9,343,350.00	0.63
16	002227	奥特迅	546,400	9,337,976.00	0.63
17	300421	力星股份	421,500	9,239,280.00	0.62
18	688408	中信博	50,484	8,910,930.84	0.60
19	603383	顶点软件	244,120	8,763,908.00	0.59
20	600079	人福医药	376,814	8,485,851.28	0.57
21	688033	天宜上佳	193,463	6,393,952.15	0.43
22	603180	金牌厨柜	154,100	5,932,850.00	0.40
23	301051	信濠光电	43,800	5,262,570.00	0.35
24	300450	先导智能	64,661	4,808,838.57	0.32

25	688663	新风光	96,140	4,536,846.60	0.31
26	603456	九洲药业	77,800	4,377,028.00	0.30
27	600519	贵州茅台	2,100	4,305,000.00	0.29
28	300118	东方日升	105,700	3,432,079.00	0.23
29	300035	中科电气	87,400	2,643,850.00	0.18
30	300049	福瑞股份	121,300	1,783,110.00	0.12
31	688187	时代电气	14,449	1,107,515.85	0.07
32	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.06
33	688167	炬光科技	2,014	355,813.38	0.02
34	603233	大参林	4,300	181,073.00	0.01
35	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
36	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
37	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
38	301035	润丰股份	603	33,936.84	0.00
39	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
40	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
41	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
42	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
43	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
44	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
45	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
46	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
47	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
48	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
49	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
50	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
51	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
52	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
53	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
54	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
55	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
56	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
57	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
58	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
59	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
60	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
61	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
62	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
63	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00

64	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
65	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
66	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
67	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
68	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
69	300059	东方财富	24	890.64	0.00
70	603355	莱克电气	1	29.32	0.00

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	600079	人福医药	67,148,420.40	12.11
2	000001	平安银行	64,801,506.34	11.69
3	002594	比亚迪	63,305,397.41	11.42
4	600519	贵州茅台	53,075,350.20	9.58
5	300035	中科电气	49,729,936.00	8.97
6	002092	中泰化学	45,865,863.00	8.27
7	601865	福莱特	45,865,219.41	8.27
8	002332	仙琚制药	36,252,643.00	6.54
9	002409	雅克科技	36,190,180.95	6.53
10	300014	亿纬锂能	34,331,797.09	6.19
11	300680	隆盛科技	34,249,290.05	6.18
12	002304	洋河股份	33,229,428.00	5.99
13	688033	天宜上佳	32,751,507.99	5.91
14	000739	普洛药业	32,159,500.82	5.80
15	002906	华阳集团	30,639,645.14	5.53
16	601939	建设银行	29,664,512.00	5.35
17	600570	恒生电子	29,542,260.78	5.33
18	601012	隆基股份	28,972,039.94	5.23
19	603105	芯能科技	28,761,687.95	5.19
20	002895	川恒股份	28,367,139.00	5.12
21	300450	先导智能	26,765,983.60	4.83
22	300760	迈瑞医疗	26,753,954.95	4.83
23	600585	海螺水泥	26,528,127.65	4.79

24	000858	五粮液	24,993,455.46	4.51
25	688408	中信博	24,638,967.22	4.45
26	300702	天宇股份	24,337,742.96	4.39
27	000333	美的集团	24,201,577.00	4.37
28	600989	宝丰能源	23,459,049.93	4.23
29	300421	力星股份	22,739,535.37	4.10
30	600409	三友化工	21,576,544.00	3.89
31	300496	中科创达	21,461,568.00	3.87
32	002386	天原股份	20,174,724.80	3.64
33	601058	赛轮轮胎	18,858,673.89	3.40
34	000568	泸州老窖	18,338,331.17	3.31
35	300122	智飞生物	18,120,560.72	3.27
36	300568	星源材质	17,528,528.83	3.16
37	603799	华友钴业	17,172,029.00	3.10
38	002080	中材科技	16,965,092.63	3.06
39	600346	恒力石化	16,884,578.01	3.05
40	601369	陕鼓动力	16,795,080.00	3.03
41	603279	景津环保	16,339,498.90	2.95
42	300059	东方财富	15,528,599.80	2.80
43	603180	金牌厨柜	15,304,664.16	2.76
44	300382	斯莱克	14,991,769.55	2.70
45	601567	三星医疗	14,882,225.67	2.68
46	600276	恒瑞医药	14,826,014.65	2.67
47	600438	通威股份	14,750,759.48	2.66
48	300258	精锻科技	14,718,481.00	2.66
49	603383	顶点软件	14,077,018.80	2.54
50	002850	科达利	13,985,555.90	2.52
51	300294	博雅生物	13,969,321.85	2.52
52	600010	包钢股份	13,885,526.00	2.51
53	600256	广汇能源	13,725,299.00	2.48
54	603658	安图生物	13,462,148.12	2.43
55	603277	银都股份	13,165,723.00	2.38
56	600660	福耀玻璃	12,831,809.34	2.31
57	000062	深圳华强	12,608,852.50	2.27
58	000672	上峰水泥	12,583,282.25	2.27
59	300682	朗新科技	11,960,288.00	2.16

60	300601	康泰生物	11,784,480.45	2.13
61	002727	一心堂	11,404,540.54	2.06
62	000786	北新建材	11,341,697.02	2.05
63	000422	湖北宜化	11,329,976.00	2.04
64	688390	固德威	11,179,972.74	2.02

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	000001	平安银行	63,656,220.36	11.48
2	300035	中科电气	63,309,485.54	11.42
3	600519	贵州茅台	51,741,616.35	9.33
4	002092	中泰化学	51,696,755.00	9.33
5	300450	先导智能	50,945,047.74	9.19
6	600079	人福医药	47,929,802.50	8.65
7	002304	洋河股份	35,437,615.00	6.39
8	002895	川恒股份	32,978,786.16	5.95
9	688033	天宜上佳	32,013,662.79	5.78
10	002386	天原股份	31,394,081.96	5.66
11	002594	比亚迪	29,984,136.00	5.41
12	601939	建设银行	28,765,838.00	5.19
13	300702	天宇股份	28,359,675.87	5.12
14	600570	恒生电子	26,937,385.42	4.86
15	300760	迈瑞医疗	26,657,508.00	4.81
16	600585	海螺水泥	25,453,689.51	4.59
17	300014	亿纬锂能	24,742,598.00	4.46
18	600989	宝丰能源	24,495,561.33	4.42
19	000858	五粮液	24,295,582.00	4.38
20	000739	普洛药业	22,077,021.00	3.98
21	600409	三友化工	20,741,056.00	3.74
22	601058	赛轮轮胎	20,616,498.25	3.72
23	601369	陕鼓动力	20,329,641.00	3.67
24	601601	中国太保	19,735,811.30	3.56
25	000568	泸州老窖	19,509,972.00	3.52
26	300122	智飞生物	19,098,347.82	3.45

27	300769	德方纳米	17,238,814.40	3.11
28	601865	福莱特	17,026,530.56	3.07
29	600346	恒力石化	16,980,840.40	3.06
30	002080	中材科技	16,974,529.00	3.06
31	601012	隆基股份	16,673,131.92	3.01
32	300568	星源材质	16,643,699.27	3.00
33	603799	华友钴业	16,333,561.00	2.95
34	002601	龙佰集团	16,307,602.00	2.94
35	600276	恒瑞医药	16,011,182.00	2.89
36	002850	科达利	15,639,106.00	2.82
37	000636	风华高科	15,495,244.88	2.80
38	300059	东方财富	15,466,865.44	2.79
39	600256	广汇能源	15,147,422.60	2.73
40	300258	精锻科技	14,801,438.00	2.67
41	603279	景津环保	14,791,880.00	2.67
42	600010	宝钢股份	14,776,992.00	2.67
43	600438	通威股份	14,692,904.76	2.65
44	601567	三星医疗	14,262,347.00	2.57
45	000651	格力电器	13,683,364.47	2.47
46	300682	朗新科技	13,341,960.83	2.41
47	002409	雅克科技	13,315,182.00	2.40
48	600036	招商银行	12,919,398.86	2.33
49	300294	博雅生物	12,888,587.25	2.33
50	600031	三一重工	12,796,187.00	2.31
51	600660	福耀玻璃	12,555,699.00	2.27
52	688408	中信博	12,315,210.20	2.22
53	603277	银都股份	11,909,631.00	2.15
54	300750	宁德时代	11,779,222.00	2.13
55	000062	深圳华强	11,585,661.82	2.09
56	000786	北新建材	11,562,087.81	2.09
57	002906	华阳集团	11,488,037.69	2.07
58	000672	上峰水泥	11,443,089.17	2.06
59	000422	湖北宜化	11,395,142.35	2.06
60	688518	联赢激光	11,340,244.89	2.05
61	300457	赢合科技	11,298,070.00	2.04
62	300421	力星股份	11,247,839.00	2.03
63	603658	安图生物	11,190,229.68	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	2,122,253,985.55
卖出股票收入（成交）总额	1,909,558,395.29

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	180,765,000.00	12.19
	其中：政策性金融债	180,765,000.00	12.19
4	企业债券	369,504,000.00	24.92
5	企业短期融资券	255,767,500.00	17.25
6	中期票据	709,919,300.00	47.88
7	可转债（可交换债）	62,345,689.32	4.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,578,301,489.32	106.46

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	160404	16 农发 04	500,000	50,465,000.00	3.40
2	210306	21 进出 06	500,000	49,965,000.00	3.37
3	101800180	18 河钢集 MTN002	350,000	36,288,000.00	2.45
4	101801098	18 西永 MTN002	300,000	30,492,000.00	2.06
5	150412	15 农发 12	300,000	30,213,000.00	2.04

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**

中国进出口银行因违规投资企业股权等原因在本报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚。

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	320,856.00
2	应收证券清算款	5,010,924.08
3	应收股利	-
4	应收利息	26,090,768.39
5	应收申购款	408,388.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,830,937.00

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127037	银轮转债	4,775,410.64	0.32
2	113619	世运转债	4,494,080.00	0.30
3	127030	盛虹转债	3,567,480.00	0.24
4	113524	奇精转债	3,464,882.00	0.23
5	113048	晶科转债	3,448,149.00	0.23
6	113024	核建转债	3,340,544.00	0.23
7	113593	沪工转债	3,290,061.60	0.22
8	110056	亨通转债	3,170,640.00	0.21
9	123075	贝斯转债	2,770,400.00	0.19
10	113046	金田转债	2,636,480.00	0.18
11	113535	大业转债	1,928,640.00	0.13
12	123107	温氏转债	1,619,760.00	0.11
13	127036	三花转债	1,135,440.00	0.08
14	111000	起帆转债	1,094,964.80	0.07
15	110058	永鼎转债	1,008,320.00	0.07
16	110062	烽火转债	808,850.00	0.05
17	110075	南航转债	685,250.00	0.05
18	128075	远东转债	646,400.00	0.04
19	127006	敖东转债	606,150.00	0.04
20	110053	苏银转债	591,800.00	0.04
21	113550	常汽转债	565,775.00	0.04
22	123115	捷捷转债	554,480.00	0.04
23	128035	大族转债	537,320.00	0.04
24	128119	龙大转债	535,080.00	0.04
25	113043	财通转债	364,470.00	0.02
26	110066	盛屯转债	351,456.00	0.02
27	123111	东财转 3	336,360.00	0.02
28	113050	南银转债	254,388.00	0.02

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
泰康恒泰回报混合 A	1,477	334,341.07	467,744,284.97	94.72%	26,077,471.45	5.28%
泰康恒泰回报混合 C	3,859	190,402.60	612,060,663.69	83.30%	122,702,988.38	16.70%
合计	5,255	233,793.61	1,079,804,948.66	87.89%	148,780,459.83	12.11%

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	泰康恒泰回报混合 A	593,509.09	0.1202%
	泰康恒泰回报混合 C	958,824.76	0.1305%
	合计	1,552,333.85	0.1264%

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	泰康恒泰回报混合 A	50~100
	泰康恒泰回报混合 C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开	泰康恒泰回报混合 A	0

开放式基金	泰康恒泰回报混合 C	0~10
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C
基金合同生效日（2016年7月13日）基金份额总额	2,345,699.92	500,010,000.00
本报告期期初基金份额总额	292,033,400.95	171,242,136.50
本报告期基金总申购份额	292,427,898.80	756,034,457.87
减：本报告期基金总赎回份额	90,639,543.33	192,512,942.30
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	493,821,756.42	734,763,652.07

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

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人未出现重大人事变动。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 85,000.00 元；截至 2021 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 6 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	
光大证券	2	2,919,604,937.20	72.79%	788,189.56	72.68%	-
招商证券	2	1,091,633,266.28	27.21%	296,342.89	27.32%	-

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、本报告期内本基金租用券商交易单元变更情况：无。

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
光大证券	398,165,532.29	46.19%	6,682,700,000.00	72.30%	-	-
招商证券	463,827,940.47	53.81%	2,560,400,000.00	27.70%	-	-

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	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金恢复非直销销售机构大额申购（含转换转入及定投）业务公告	《中国证券报》、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9日
2	泰康恒泰回报灵活配置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	《中国证券报》、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9日
3	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第一次分红公告	《中国证券报》、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
4	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入及定投）业务公告	《中国证券报》、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15日
5	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	《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	2021年8月13日

	持有最低限额的公告	子披露网站及基金管理人网站	
6	泰康恒泰回报灵活配置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	《中国证券报》、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
7	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第二次分红公告	《中国证券报》、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24日
8	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购(含转换转入及定投)业务公告	《中国证券报》、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25日
9	关于调整泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金在部分销售机构最低申购金额;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》、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23日
10	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
11	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
12	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
13	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农业银行股份有限公司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1月29日
14	关于泰康资产管理有限责任	《中国证券报》、《上	2021年2月8日

	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	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	
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
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
17	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
18	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
19	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
20	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4月30日
21	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、	2021年5月10日

	司为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	
22	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
23	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
24	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
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
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
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管理人网站	2021 年 6 月 17 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	2021 年 6 月 18 日

		管理人网站	
29	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
30	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
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
32	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
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
34	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
35	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7月26日
36	关于旗下基金开展直销电子	《中国证券报》、《上	2021年7月30日

	交易系统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	
37	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
38	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
39	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
40	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
41	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
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招商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9月3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北京创金启富基金销售有	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、	2021年9月6日

	限公司为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	
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
45	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
46	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
47	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
48	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
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管理人网站	2021 年 10 月 22 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	2021 年 10 月 28 日

		管理人网站	
51	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
52	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
53	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
54	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
55	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
56	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
57	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 12 月 31 日

§ 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恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康恒泰回报灵活配置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（《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

2022年3月31日