

泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17

6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
§ 7 投资组合报告.....	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§ 8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	56
§ 9 开放式基金份额变动.....	57
§ 10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	泰康新回报灵活配置混合	
基金主代码	001798	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 9 月 23 日	
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	78,281,527.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001798	001799
报告期末下属分级基金的份额总额	68,792,891.43 份	9,488,636.48 份

2.2 基金产品说明

投资目标	积极灵活配置资产，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。
投资策略	本基金采取定性分析与定量分析相结合的分析框架，通过自上而下的方法精选投资标的，灵活配置大类资产，在控制风险的前提下进行投资管理，力争利用主动式组合管理获得超过业绩比较基准的收益。 具体来看，本基金综合考虑多种因素，对国内外宏观经济形势与政策、市场利率走势、信用利差水平、利率期限结构以及证券市场走势等因素进行分析，在本基金合同约定范围内制定合理的资产配置计划。
业绩比较基准	30%*沪深 300 指数收益率+65%*中债新综合财富（总值）指数收益率+5%*金融机构人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和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	北京银行股份有限公司
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	95526
传真	010-57818785	010-66225309

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码	100033	100033
法定代表人	段国圣	霍学文

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰康资产管理有限责任公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C
本期已实现收益	-21,572,899.22	-2,946,477.78
本期利润	-24,251,780.89	-3,260,724.73
加权平均基金份额本期利润	-0.3434	-0.3390
本期加权平均净值利润率	-20.15%	-20.06%
本期基金份额净值增长率	-15.76%	-15.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	43,062,060.86	5,916,214.55
期末可供分配基金份额利润	0.6260	0.6235
期末基金资产净值	120,092,466.22	16,413,793.06
期末基金份额净值	1.7457	1.7298
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	74.57%	70.65%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

泰康新回报灵活配置混合 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

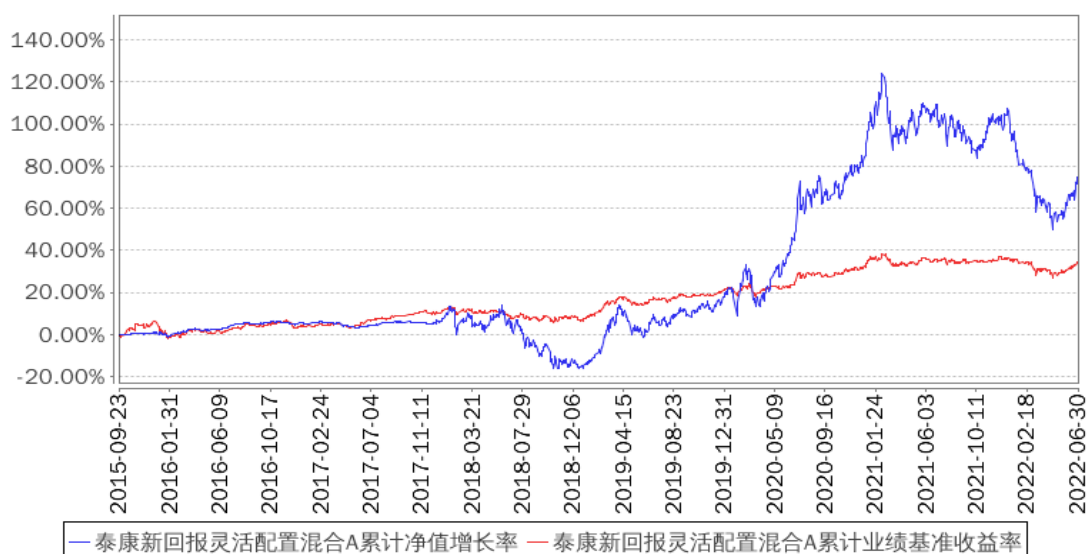
过去一个月	7.59%	1.26%	2.82%	0.32%	4.77%	0.94%
过去三个月	7.28%	1.35%	2.66%	0.43%	4.62%	0.92%
过去六个月	-15.76%	1.35%	-1.44%	0.44%	-14.32%	0.91%
过去一年	-16.53%	1.28%	-1.13%	0.37%	-15.40%	0.91%
过去三年	62.75%	1.35%	15.18%	0.37%	47.57%	0.98%
自基金合同 生效起至今	74.57%	1.11%	34.23%	0.38%	40.34%	0.73%

泰康新回报灵活配置混合 C

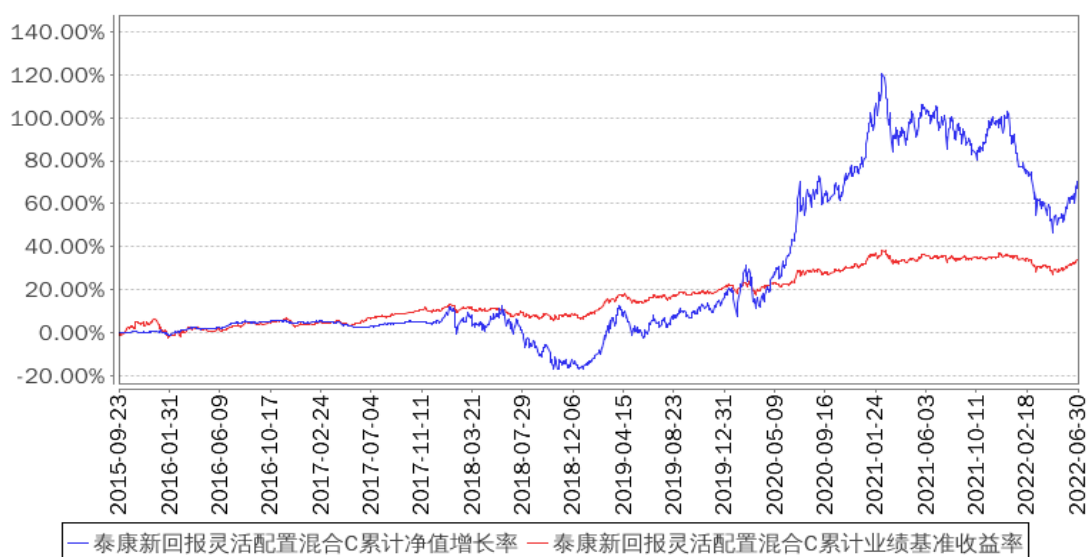
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增长 率标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.55%	1.26%	2.82%	0.32%	4.73%	0.94%
过去三个月	7.17%	1.35%	2.66%	0.43%	4.51%	0.92%
过去六个月	-15.93%	1.35%	-1.44%	0.44%	-14.49%	0.91%
过去一年	-16.87%	1.28%	-1.13%	0.37%	-15.74%	0.91%
过去三年	61.08%	1.35%	15.18%	0.37%	45.90%	0.98%
自基金合同 生效起至今	70.65%	1.11%	34.23%	0.38%	36.42%	0.73%

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

泰康新回报灵活配置混合A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



泰康新回报灵活配置混合C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 2015 年 09 月 23 日生效。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 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。

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 2022 年 6 月 30 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、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证券投资基金、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基金中基金（FOF）、泰康研究精选股票型发起式证券投资基金、泰康沪港深成长混合型证券投资基金、泰康医疗健康股票型发起式证券投资基金、泰康招享混合型证券投资基金，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		
陈怡	本基金基金经理	2017 年 11 月 28 日	-	10 年	陈怡于 2016 年 5 月加入泰康资产，历任万家基金管理有限公司研究部研究员，平安养老保险股份有限公司权益投资部研究员、行业投资经理。2017 年 4 月 19 日至今担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2017 年 4 月 19 日至 2019 年 5 月 8 日担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 10 月 13 日至今担任泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 9 日至今担任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 28 日至今担任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 1 月 19 日至 2019 年 5 月 8 日担任泰康均衡优选混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 23 日至今担任泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 3 月 22 日至 2021 年 12 月 7 日担任泰康裕泰债券型证券投资基金基金经理。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。2021 年 6 月 2 日至今

					担任泰康浩泽混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2022 年上半年受到疫情较大扰动，经济的表现一波三折。1-2 月宏观表现较为稳健，但 3 月份开始疫情在全国散发，部分地区经历了静默，经济活动明显受限。随着疫情逐步得控，5-6 月经济走出低谷。政策也加大了调节力度，包括较大规模的留抵退税安排、债券发行前置、流动性宽松、地产因城施策放松等。各部门的经济活动也因此有所分化，居民消费和收

入等受到一定的影响，投资活动中房地产较弱，基建和制造业则有一定表现，出口则由于国内供应链的恢复而明显复苏。物价方面，海外通胀居高不下，国内 PPI 同比下行，CPI 中食品和核心 CPI 表现分化。

权益市场方面，一季度，自 2021 年 12 月高点起，市场逐步经历了估值过高交易拥挤，国内经济下行，俄乌战争导致的滞涨，美联储加息等多重风险冲击，市场估值风险初步释放，稳增长政策方向得以确定。二季度市场波动较大，四月份基于对未来经济的不确定性引发了市场大幅下跌，各种资金充分出清；五月份起，一方面国内受疫情影响的经济开始修复，稳增长政策力度较强，修复了市场的风险偏好，另一方面，海外衰退预期逐步增强，美联储加息风险放缓，国内估值压力大幅缓解。从大盘和板块上来看，上证综指下跌 6.63%，沪深 300 下跌 9.22%，中小板指下跌 11.56%，创业板指下跌 15.41%。其中，煤炭、消费者服务、交通运输等板块表现相对较好，综合金融、传媒、电子等行业表现不佳。

权益投资方面，本基金在一季度降低了仓位，减持了成长风格板块，同时结构上增加了周期和防御性板块的配置，并且在消费和医药板块上做了个股的优化。今年二季度起，市场极度悲观，我们自四月中下旬开始逐渐提升权益仓位，对我们之前关注的跌入偏低或合理估值区间的优质公司加仓，主要集中在消费和中游制造等行业；整体而言侧重于自下而上精选个股，注重标的的安全边际。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康新回报 A 基金份额净值为 1.7457 元，本报告期基金份额净值增长率为 -15.76%；截至本报告期末泰康新回报 C 基金份额净值为 1.7298 元，本报告期基金份额净值增长率为 -15.93%；同期业绩比较基准增长率为 -1.44%。

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 年下半年，宏观经济有望呈现复苏的态势，但幅度不会太强，总体上是斜率偏慢、存在阻力的复苏。阻力主要来源于两个方面，一是随着海外衰退压力逐步加大，外需下滑对出口的影响需要关注；二是房地产部门对于经济的影响。但在常态化防控、疫情总体可控的背景下，下半年消费、服务业等有望逐步缓慢恢复；此外，逆周期政策也将逐步落地见效，前期集中发行的专项债预计将逐步形成实物工作量，流动性宽松也对总体融资需求有所呵护。

权益市场方面，展望未来，市场在前期大幅下跌之后出现反弹，前期跌幅较大的成长板块如军工、新能源以及受购置税减免政策刺激的汽车板块涨幅较大；与之相对应的，地产产业链以及金融板块在和房地产和宏观经济的压力下持续回调。流动性方面，国内银行间流动性仍较为宽松，

实体融资需求不佳，资金利率持续走低，呈现“衰退式宽松”的格局，结构性资产荒的现象依然没有改变。在弱经济和宽松流动性的组合下，成长赛道更受到市场的青睐，但是高景气赛道伴随着高预期和高估值，增加了选股的难度。

权益投资方面，我们更倾向于自下而上选股，配置有安全边际的、业绩和估值相匹配的公司，争取在下半年获得更好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有公募估值小组，并制定了相关制度及流程。公司公募估值小组设成员若干名，成员由公募各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理部、投资部、监察稽核部等。公募估值小组成员均具有相关工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容，复核内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,616,386.84	10,517,745.76
结算备付金		1,273,762.94	1,093,947.90
存出保证金		173,914.37	173,762.94
交易性金融资产	6.4.7.2	126,006,094.50	158,786,919.47
其中：股票投资		120,852,900.63	158,786,919.47
基金投资		-	-
债券投资		5,153,193.87	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	6,000,000.00	5,000,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,664,040.36	1,022,028.30
应收股利		-	-
应收申购款		17,955.43	4,827.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-49.40
资产总计		138,752,154.44	176,599,182.51
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,716,824.42	1,173,572.13
应付赎回款		203,230.12	68,219.62

应付管理人报酬		107,651.24	146,392.38
应付托管费		16,147.69	21,958.89
应付销售服务费		5,169.26	6,878.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.14	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	196,872.29	106,061.38
负债合计		2,245,895.16	1,523,082.58
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	78,281,527.91	84,551,825.36
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	58,224,731.37	90,524,274.57
净资产合计		136,506,259.28	175,076,099.93
负债和净资产总计		138,752,154.44	176,599,182.51

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，泰康新回报灵活配置混合 A 基金份额净值 1.7457 元，基金份额总额 68,792,891.43 份；泰康新回报灵活配置混合 C 基金份额净值 1.7298 元，基金份额总额 9,488,636.48 份。泰康新回报灵活配置混合份额总额合计为 78,281,527.91 份。

6.2 利润表

会计主体：泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-26,599,425.08	19,466,112.31
1. 利息收入		135,311.68	162,026.01
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,622.52	54,321.89
债券利息收入		-	4,099.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		106,689.16	103,605.03
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-23,746,077.40	44,906,823.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-24,525,754.79	43,861,942.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	36,915.42	244,206.94
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-

股利收益	6.4.7.19	742,761.97	800,673.97
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-2,993,128.62	-25,732,477.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	4,469.26	129,739.87
减：二、营业总支出		913,080.54	1,712,625.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	680,015.18	1,001,246.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	102,002.27	150,187.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	32,346.58	37,177.11
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.01	0.54
8. 其他费用	6.4.7.23	98,716.50	524,014.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-27,512,505.62	17,753,486.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-27,512,505.62	17,753,486.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-27,512,505.62	17,753,486.52

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	84,551,825.36	-	90,524,274.57	175,076,099.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	84,551,825.36	-	90,524,274.57	175,076,099.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,270,297.45	-	-32,299,543.20	-38,569,840.65

(一)、综合收益总额	-	-	-27,512,505.62	-27,512,505.62
(二)、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)	-6,270,297.45	-	-4,787,037.58	-11,057,335.03
其中：1. 基金申购款	1,531,612.06	-	1,107,600.88	2,639,212.94
2. 基金赎回款	-7,801,909.51	-	-5,894,638.46	-13,696,547.97
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	78,281,527.91	-	58,224,731.37	136,506,259.28
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	103,320,491.36	-	93,823,688.28	197,144,179.64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	103,320,491.36	-	93,823,688.28	197,144,179.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,043,503.52	-	14,392,083.99	10,348,580.47
(一)、综合收益总额	-	-	17,753,486.52	17,753,486.52
(二)、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)	-4,043,503.52	-	-3,361,402.53	-7,404,906.05
其中：1. 基金申购款	29,942,298.82	-	31,316,023.40	61,258,322.22
2. 基金赎回款	-33,985,802.34	-	-34,677,425.93	-68,663,228.27
(三)、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)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	99,276,987.84	-	108,215,772.27	207,492,760.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>段国圣</u>	<u>金志刚</u>	<u>李俊佐</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康新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[2015]1808号《关于准予泰康新回报灵活配置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《泰康新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264,165,508.96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(2015)第1114号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年9月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为264,167,657.82份基金份额,其中认购资金利息折合2,148.86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,基金托管人为北京银行股份有限公司(以下简称“北京银行”)。

根据《泰康新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《泰康新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)、权证、

股指期货、国债期货、债券资产(包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 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:30%×沪深 300 指数收益率+65%×中债新综合财富(总值)指数收益率+5%×金融机构人民币活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康新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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”),财政部、中国银行保险监督管理委员会

员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

(b) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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

以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

(c) 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率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投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率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投资收益。

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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率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。

(d) 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。

以摊余成本计量的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。

(e) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 10,517,745.76 元、1,093,947.90 元、173,762.94 元、5,000,000.00 元、-49.40 元、1,022,028.30 元和 4,827.54 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 10,518,839.01 元、1,094,489.43 元、173,848.96 元、4,998,228.77 元、0.00 元、1,022,028.30 元和 4,828.57 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 158,786,919.47 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融

资产为交易性金融资产，金额为 158,786,919.47 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,173,572.13 元、68,219.62 元、146,392.38 元、21,958.89 元、6,878.18 元、56,982.46 元和 49,078.92 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,173,572.13 元、68,219.62 元、146,392.38 元、21,958.89 元、6,878.18 元、56,982.46 元和 49,078.92 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(f) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政

策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适

用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2022年6月30日
活期存款	3,616,386.84
等于：本金	3,615,992.02
加：应计利息	394.82
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,616,386.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	111,154,754.02	-	120,852,900.63	9,698,146.61	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	5,100,076.80	49,549.87	5,153,193.87	3,567.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,100,076.80	49,549.87	5,153,193.87	3,567.20
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	116,254,830.82	49,549.87	126,006,094.50	9,701,713.81	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本报告期末，本基金无计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

本报告期末，本基金未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本报告期末，本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本报告期末，本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	78.26
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	68,450.87
其中：交易所市场	68,450.87
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	128,343.16
合计	196,872.29

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	74,728,117.64	74,728,117.64
本期申购	699,739.54	699,739.54
本期赎回 (以“-”号填列)	-6,634,965.75	-6,634,965.75
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	68,792,891.43	68,792,891.43

泰康新回报灵活配置混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	9,823,707.72	9,823,707.72
本期申购	831,872.52	831,872.52
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,166,943.76	-1,166,943.76
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	9,488,636.48	9,488,636.48

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本报告期末，本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

泰康新回报灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	69,582,904.84	10,551,923.25	80,134,828.09
本期利润	-21,572,899.22	-2,678,881.67	-24,251,780.89
本期基金份额交易产生的变动数	-4,947,944.76	364,472.35	-4,583,472.41
其中：基金申购款	560,934.95	-56,009.33	504,925.62
基金赎回款	-5,508,879.71	420,481.68	-5,088,398.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,062,060.86	8,237,513.93	51,299,574.79

泰康新回报灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	9,132,176.93	1,257,269.55	10,389,446.48
本期利润	-2,946,477.78	-314,246.95	-3,260,724.73

本期基金份额交易产生的变动数	-269,484.60	65,919.43	-203,565.17
其中：基金申购款	656,310.37	-53,635.11	602,675.26
基金赎回款	-925,794.97	119,554.54	-806,240.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,916,214.55	1,008,942.03	6,925,156.58

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入		14,525.16
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		12,688.02
其他		1,409.34
合计		28,622.52

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-24,525,754.79
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		-24,525,754.79

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
卖出股票成交总额		287,777,622.88
减：卖出股票成本总额		311,806,324.48
减：交易费用		497,053.19
买卖股票差价收入		-24,525,754.79

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
债券投资收益——利息收入		21,117.81

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	15,797.61
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	36,915.42

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	146,111.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	130,300.00
减：应计利息总额	7.94
减：交易费用	5.83
买卖债券差价收入	15,797.61

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本报告期，本基金无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	742,761.97
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	742,761.97

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,993,128.62
股票投资	-2,996,695.82
债券投资	3,567.20
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-2,993,128.62

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	3,817.96
基金转换费收入	651.30
合计	4,469.26

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

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

6.4.7.22 信用减值损失

本报告期，本基金无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	773.34
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	98,716.50

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期基金管理人成立控股子公司泰康基金管理有限公司。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	680,015.18	1,001,246.99
其中：支付销售机构的客户维护费	93,567.79	189,415.01

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%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% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	102,002.27	150,187.07

注：支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康新回报灵活配置混合	泰康新回报灵活配置混合	合计

	A	C	
泰康资产管理有限责任公司	-	28,807.28	28,807.28
合计	-	28,807.28	28,807.28
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C	合计
泰康资产管理有限责任公司	-	33,148.96	33,148.96
合计	-	33,148.96	33,148.96

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 0.4% 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 = 前一日基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，本基金管理人之外的其他关联方未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行	3,616,386.84	14,525.16	13,718,825.63	44,220.51

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股锁定期流通受限	55.57	30.03	106	5,890.42	3,183.18	-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股锁定期流通受限	50.31	70.37	89	4,477.59	6,262.93	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股锁定期流通受限	37.23	25.39	139	5,174.97	3,529.21	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股锁定期流通受限	64.08	37.52	57	3,652.56	2,138.64	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股锁定期流通受限	76.56	51.92	80	6,124.80	4,153.60	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股锁定期流通受限	56.88	56.42	109	6,199.92	6,149.78	-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股锁定期流通受限	20.08	20.34	323	6,485.84	6,569.82	-

301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股锁定期流通受限	39.30	37.93	188	7,388.40	7,130.84	-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	网下新股流通受限	41.27	41.27	1,379	56,911.33	56,911.33	-
688281	华秦科技	2022年2月28日	6个月	新股锁定期流通受限	189.50	246.22	478	64,619.50	117,693.16	-
688326	经纬恒润	2022年4月11日	6个月	新股锁定期流通受限	121.00	134.07	607	73,447.00	81,380.49	-

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份，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份，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份数量的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。

6、根据华秦科技 2021 年年度权益分派实施公告，以方案实施前的公司总股本 66,666,668.00 股为基数，向全体股东每股派发现金红利 0.35 元（含税），每股派送红股 0.4 股。除权除息日为 2022 年 6 月 6 日，本基金所持有的华秦科技获得转增股 137 股。

7、截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公

司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制订了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围內。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人北京银行股份有限公司，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据

等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,616,386.84	-	-	-	3,616,386.84
结算备付金	1,273,762.94	-	-	-	1,273,762.94
存出保证金	173,914.37	-	-	-	173,914.37
交易性金融资产	5,153,193.87	-	-	120,852,900.63	126,006,094.50
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收申购款	-	-	-	17,955.43	17,955.43
应收清算款	-	-	-	1,664,040.36	1,664,040.36
资产总计	16,217,258.02	-	-	122,534,896.42	138,752,154.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	203,230.12	203,230.12
应付管理人报酬	-	-	-	107,651.24	107,651.24
应付托管费	-	-	-	16,147.69	16,147.69
应付清算款	-	-	-	1,716,824.42	1,716,824.42
应付销售服务费	-	-	-	5,169.26	5,169.26
应交税费	-	-	-	0.14	0.14
其他负债	-	-	-	196,872.29	196,872.29
负债总计	-	-	-	2,245,895.16	2,245,895.16
利率敏感度缺口	16,217,258.02	-	-	-120,289,001.26	136,506,259.28
上年度末 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	10,517,745.76	-	-	-	10,517,745.76
结算备付金	1,093,947.90	-	-	-	1,093,947.90
存出保证金	173,762.94	-	-	-	173,762.94
交易性金融资产	-	-	-	158,786,919.47	158,786,919.47
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,022,028.30	1,022,028.30
应收申购款	499.40	-	-	4,328.14	4,827.54
其他资产	-	-	-	-49.40	-49.40
资产总计	16,785,956.00	-	-	159,813,226.51	176,599,182.51
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,173,572.13	1,173,572.13
应付赎回款	-	-	-	68,219.62	68,219.62
应付管理人报酬	-	-	-	146,392.38	146,392.38
应付托管费	-	-	-	21,958.89	21,958.89
应付销售服务费	-	-	-	6,878.18	6,878.18
其他负债	-	-	-	106,061.38	106,061.38

负债总计	-	-	-	1,523,082.58	1,523,082.58
利率敏感度缺口	16,785,956.00	-	-	-158,290,143.93	175,076,099.93

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	市场利率上调 0.25%	-6,878.04	0.00
	市场利率下调 0.25%	6,896.45	0.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金本期的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	120,852,900.63	88.53	158,786,919.47	90.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	120,852,900.63	88.53	158,786,919.47	90.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	业绩比较基准中的权益指数上涨5%	5,923,297.17	6,365,391.18
	业绩比较基准中的权益指数下跌5%	-5,923,297.17	-6,365,391.18

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	120,557,797.65	158,171,406.11

第二层次	5,210,105.20	180,160.25
第三层次	238,191.65	435,353.11
合计	126,006,094.50	158,786,919.47

6.4.14.2.2 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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	120,852,900.63	87.10
	其中：股票	120,852,900.63	87.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,153,193.87	3.71
	其中：债券	5,153,193.87	3.71
	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	6,000,000.00	4.32
	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	4,890,149.78	3.52
8	其他各项资产	1,855,910.16	1.34
9	合计	138,752,154.44	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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	75,194,380.74	55.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,865,073.85	13.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,416,228.48	4.70
J	金融业	18,605,852.90	13.63
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	13,700.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	2,757,664.00	2.02
S	综合	-	-
	合计	120,852,900.63	88.53

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603345	安井食品	46,424	7,793,196.88	5.71
2	600030	中信证券	326,755	7,077,513.30	5.18
3	600233	圆通速递	341,800	6,969,302.00	5.11
4	601021	春秋航空	119,011	6,944,291.85	5.09
5	600031	三一重工	337,800	6,438,468.00	4.72
6	300059	东方财富	246,960	6,272,784.00	4.60
7	600399	抚顺特钢	334,300	5,983,970.00	4.38
8	002463	沪电股份	394,600	5,824,296.00	4.27
9	600600	青岛啤酒	52,800	5,486,976.00	4.02
10	002179	中航光电	85,880	5,437,921.60	3.98
11	300285	国瓷材料	147,500	5,298,200.00	3.88
12	001215	千味央厨	89,600	5,043,584.00	3.69
13	000729	燕京啤酒	503,437	4,863,201.42	3.56
14	002006	精功科技	138,700	4,123,551.00	3.02
15	002468	申通快递	331,500	3,951,480.00	2.89
16	688111	金山办公	18,130	3,573,785.60	2.62
17	688295	中复神鹰	93,532	3,506,514.68	2.57
18	688800	瑞可达	23,393	2,954,769.83	2.16
19	002410	广联达	51,900	2,825,436.00	2.07
20	300251	光线传媒	291,200	2,757,664.00	2.02
21	600760	中航沈飞	45,500	2,750,475.00	2.01
22	000776	广发证券	145,300	2,717,110.00	1.99
23	601688	华泰证券	177,500	2,520,500.00	1.85
24	000786	北新建材	60,000	2,077,200.00	1.52
25	688308	欧科亿	30,859	2,053,975.04	1.50
26	300124	汇川技术	24,500	1,613,815.00	1.18
27	601100	恒立液压	24,600	1,518,312.00	1.11
28	301029	怡合达	15,500	1,263,250.00	0.93
29	300751	迈为股份	680	333,812.00	0.24
30	600309	万华化学	2,100	203,679.00	0.15

31	300408	三环集团	6,300	189,630.00	0.14
32	688281	华秦科技	478	117,693.16	0.09
33	688326	经纬恒润	607	81,380.49	0.06
34	688237	超卓航科	1,379	56,911.33	0.04
35	603517	绝味食品	972	56,201.04	0.04
36	600085	同仁堂	800	42,304.00	0.03
37	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
38	601166	兴业银行	800	15,920.00	0.01
39	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
40	603444	吉比特	25	9,700.00	0.01
41	300496	中科创达	56	7,306.88	0.01
42	301235	华康医疗	188	7,130.84	0.01
43	301228	实朴检测	323	6,569.82	0.00
44	600809	山西汾酒	20	6,496.00	0.00
45	301122	采纳股份	89	6,262.93	0.00
46	301207	华兰疫苗	109	6,149.78	0.00
47	301200	大族数控	99	5,179.60	0.00
48	301123	奕东电子	139	3,529.21	0.00
49	300834	星辉环材	106	3,183.18	0.00
50	301196	唯科科技	57	2,138.64	0.00
51	600036	招商银行	48	2,025.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601688	华泰证券	8,865,816.00	5.06
2	600600	青岛啤酒	7,798,639.90	4.45
3	300059	东方财富	6,604,893.20	3.77
4	601899	紫金矿业	6,051,972.00	3.46
5	601211	国泰君安	5,920,464.00	3.38
6	600383	金地集团	5,870,887.91	3.35
7	002120	韵达股份	5,740,301.82	3.28
8	600031	三一重工	5,732,410.00	3.27
9	002463	沪电股份	5,582,198.00	3.19
10	000776	广发证券	5,331,765.00	3.05
11	600399	抚顺特钢	5,118,840.00	2.92
12	300285	国瓷材料	5,042,514.00	2.88
13	002353	杰瑞股份	4,957,008.50	2.83
14	000915	华特达因	4,946,320.30	2.83
15	600887	伊利股份	4,875,389.14	2.78

16	000975	银泰黄金	4,681,928.00	2.67
17	000729	燕京啤酒	4,630,801.96	2.65
18	001215	千味央厨	4,527,500.10	2.59
19	000921	海信家电	4,327,141.00	2.47
20	600988	赤峰黄金	4,254,752.00	2.43
21	688111	金山办公	4,222,949.71	2.41
22	300760	迈瑞医疗	4,164,044.00	2.38
23	601808	中海油服	4,082,652.00	2.33
24	600233	圆通速递	4,048,469.00	2.31
25	000786	北新建材	3,932,540.00	2.25
26	300737	科顺股份	3,920,156.00	2.24
27	300777	中简科技	3,744,790.00	2.14
28	002006	精工科技	3,643,026.00	2.08
29	000895	双汇发展	3,637,797.00	2.08
30	601021	春秋航空	3,623,175.00	2.07
31	605123	派克新材	3,597,761.00	2.05
32	688295	中复神鹰	3,594,613.82	2.05
33	002468	申通快递	3,591,171.00	2.05

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000776	广发证券	7,342,289.00	4.19
2	300760	迈瑞医疗	7,047,600.44	4.03
3	002241	歌尔股份	7,037,532.00	4.02
4	002013	中航机电	6,551,496.00	3.74
5	002463	沪电股份	6,013,484.00	3.43
6	002120	韵达股份	5,924,921.00	3.38
7	600754	锦江酒店	5,791,899.00	3.31
8	600383	金地集团	5,686,917.44	3.25
9	600988	赤峰黄金	5,538,419.00	3.16
10	601899	紫金矿业	5,452,486.00	3.11
11	000915	华特达因	5,264,564.00	3.01
12	601211	国泰君安	5,041,308.34	2.88
13	002332	仙琚制药	5,019,291.00	2.87
14	600893	航发动力	5,002,197.00	2.86
15	600038	中直股份	4,984,076.00	2.85
16	002179	中航光电	4,981,092.58	2.85
17	600887	伊利股份	4,866,514.00	2.78

18	601688	华泰证券	4,812,387.00	2.75
19	688800	瑞可达	4,765,629.93	2.72
20	603100	川仪股份	4,763,779.00	2.72
21	000975	银泰黄金	4,471,050.00	2.55
22	300870	欧陆通	4,397,019.46	2.51
23	300294	博雅生物	4,317,938.00	2.47
24	600029	南方航空	4,178,281.00	2.39
25	002318	久立特材	4,050,735.00	2.31
26	002299	圣农发展	3,870,208.20	2.21
27	000921	海信家电	3,863,196.00	2.21
28	002353	杰瑞股份	3,853,661.37	2.20
29	603345	安井食品	3,779,253.50	2.16
30	600900	长江电力	3,526,933.00	2.01

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	276,869,001.46
卖出股票收入（成交）总额	287,777,622.88

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,153,193.87	3.78
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,153,193.87	3.78

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	50,960	5,153,193.87	3.78

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

中信证券股份有限公司因设立海外投资公司未按《证券法》报会批准等原因在本报告编制前一年内受到证监会的行政处罚。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	173,914.37
2	应收清算款	1,664,040.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,955.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,855,910.16

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
泰康新回报灵活配置混合 A	989	69,558.03	45,096,179.47	65.55	23,696,711.96	34.45
泰康新回报灵活配置混合 C	573	16,559.58	-	-	9,488,636.48	100.00
合计	1,533	51,064.27	45,096,179.47	57.61	33,185,348.44	42.39

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰康新回报灵活配置混合 A	916,999.85	1.3330
	泰康新回报灵活配置混合 C	339,247.13	3.5753
	合计	1,256,246.98	1.6048

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	泰康新回报灵活配置混合 A	0
	泰康新回报灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康新回报灵活配置混合 A	50~100
	泰康新回报灵活配置混合 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日） 基金份额总额	161,667,057.82	102,500,600.00
本报告期期初基金份额总额	74,728,117.64	9,823,707.72
本报告期基金总申购份额	699,739.54	831,872.52
减：本报告期基金总赎回份额	6,634,965.75	1,166,943.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	68,792,891.43	9,488,636.48

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国泰君安	2	561,692,691.48	100.00	153,006.16	100.00	-
招商证券	3	-	-	-	-	-

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 1 个交易单元，招商证券北京证券交易所交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰君安	5,246,183.98	100.00	1,290,000,000.00	100.00	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于泰康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	2022 年 01 月 17 日
2	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平安银行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	2022 年 01 月 21 日
3	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年“春节”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	2022 年 01 月 25 日
4	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加广发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	2022 年 02 月 11 日
5	关于泰康资产管理有限责任公司旗下	《中国证券报》；《上海	2022 年 02 月 16 日

	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	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	
6	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攀赢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	2022 年 02 月 22 日
7	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安信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	2022 年 02 月 24 日
8	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海凯石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	2022 年 02 月 25 日
9	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平安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	2022 年 02 月 28 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参加平安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	2022 年 02 月 28 日
11	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雪球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	2022 年 03 月 08 日
12	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上海长量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	2022 年 03 月 11 日
13	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上海万得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	2022 年 03 月 11 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在部分销售机构开通定投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	2022 年 03 月 17 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诺亚正行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	2022 年 03 月 21 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东方财富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	2022 年 03 月 21 日
17	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年“清明节”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	2022 年 03 月 29 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京东肯特瑞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	2022 年 03 月 29 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参加上海利得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	2022 年 04 月 02 日
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博时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	2022 年 04 月 02 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广发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	2022 年 04 月 15 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参加泰信财富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	2022 年 04 月 18 日

		基金管理人网站	
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	2022 年 04 月 20 日
24	泰康资产管理有限责任公司关于暂停深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 04 月 21 日
25	泰康资产管理有限责任公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 04 月 26 日
26	泰康资产管理有限责任公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	《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	2022 年 04 月 29 日
27	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浙江同花顺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	2022 年 05 月 13 日
28	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华泰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	2022 年 05 月 18 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	2022 年 05 月 18 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江苏银行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	2022 年 05 月 20 日
31	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部分销售机构最低申购金额、追加申购最低金额、	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监	2022 年 05 月 26 日

	赎回最低份额和持有最低限额的公告	会基金电子披露网站及基金管理人网站	
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	2022 年 05 月 27 日
33	泰康资产管理有限责任公司关于完成设立泰康基金管理有限公司的公告	《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	2022 年 05 月 28 日
34	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宁波银行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	2022 年 05 月 30 日
35	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年“端午节”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	2022 年 05 月 31 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新增上海华夏财富投资管理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	2022 年 06 月 10 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恒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	2022 年 06 月 14 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联泰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	2022 年 06 月 15 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玄元保险代理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	2022 年 06 月 22 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和讯信息科技有限公司有	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；	2022 年 06 月 23 日

	限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
41	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浙江同花顺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	2022 年 06 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101-20220630	21,234,500.00	0.00	0.00	21,234,500.00	27.13
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时,基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回,投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险,以及当管理人确认大额申购与大额赎回时,可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《上海证券报》）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 8 月 31 日