

泰康研究精选股票型发起式证券投资基金 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：国信证券股份有限公司

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。

基金托管人国信证券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..... | 7 |
| 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..... | 12 |
| 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..... | 14 |
| 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..... | 20 |
| § 7 投资组合报告..... | 53 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 53 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 53 |
| 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..... | 54 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 55 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 58 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 58 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 58 |
| § 8 基金份额持有人信息..... | 59 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 59 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 59 |
| 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..... | 59 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 60 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 61 |
| § 10 重大事件揭示..... | 62 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 62 |
| 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..... | 62 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 62 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 62 |

| | |
|---|-----------|
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 62 |
| 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..... | 62 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 62 |
| 10.8 其他重大事件..... | 63 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 69 |
| 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..... | 69 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 69 |
| § 12 备查文件目录..... | 70 |
| 12.1 备查文件目录..... | 70 |
| 12.2 存放地点..... | 70 |
| 12.3 查阅方式..... | 70 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金名称 | 泰康研究精选股票型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 泰康研究精选股票发起 | |
| 基金主代码 | 014416 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 12 月 28 日 | |
| 基金管理人 | 泰康资产管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 国信证券股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 117,846,672.46 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 泰康研究精选股票发起 A | 泰康研究精选股票发起 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 014416 | 014417 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 16,732,453.28 份 | 101,114,219.18 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金依托基金管理人权益研究能力，通过对企业的深入、系统、科学研究，筛选具有投资价值的标的构建投资组合，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过基金管理人构建的权益投资决策分析体系（MVPCT 系统）定期评估宏观经济和投资环境，并对全球及国内经济发展进行评估和展望，在此基础上判断未来市场投资环境的变化以及市场发展的主要推动因素与变量，运用泰康量化资产配置模型，根据股票、债券、货币市场工具三种最主要大类资产的预期收益和风险，确定三者的最优配置比例并适时调整。本基金依托基金管理人权益研究能力，通过对企业的深入、系统、科学研究，筛选具有投资价值的标的构建投资组合，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。同时，根据基金流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行利率债、信用债的投资。在严格控制风险的前提下，以套期保值为主要目的，本基金将本着谨慎原则适度参与股指期货和国债期货投资。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*80%+恒生指数收益率*10%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*10% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|--|---------------------------------|
| 名称 | | 泰康资产管理有限责任公司 | 国信证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 陈玮光 | 薛璐 |
| | 联系电话 | 010-58753683 | 0755-22940163 |
| | 电子邮箱 | chenwg06@taikangamc.com.cn | 03339@guosen.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4001895522 | 0755-61897778 |
| 传真 | | 010-57818785 | 0755-22940165 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室 | 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 |
| 办公地址 | | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层 | 深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼 |
| 邮政编码 | | 100033 | 518000 |
| 法定代表人 | | 段国圣 | 518000 |

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) | |
|---------------|------------------------------|----------------|
| | 泰康研究精选股票发起 A | 泰康研究精选股票发起 C |
| 本期已实现收益 | -1,697,459.50 | -10,692,324.04 |
| 本期利润 | -1,655,356.49 | -10,574,982.04 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1018 | -0.1054 |
| 本期加权平均净值利润率 | -11.57% | -12.00% |
| 本期基金份额净值增长率 | -10.06% | -10.29% |
| 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 | -1,749,569.14 | -10,784,951.25 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1046 | -0.1067 |
| 期末基金资产净值 | 15,256,364.70 | 91,961,891.76 |
| 期末基金份额净值 | 0.9118 | 0.9095 |
| 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 | -8.82% | -9.05% |

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。

（4）本基金合同生效日为 2021 年 12 月 28 日，截止报告期末本基金未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰康研究精选股票发起 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
| | | | | | | |

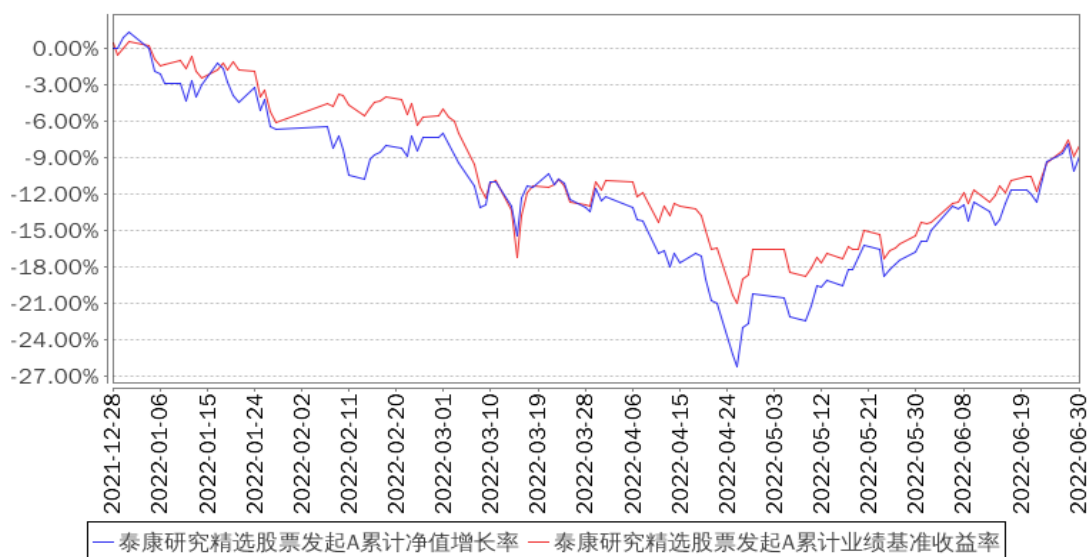
| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一个月 | 8.35% | 1.29% | 7.39% | 0.97% | 0.96% | 0.32% |
| 过去三个月 | 4.29% | 1.62% | 4.19% | 1.31% | 0.10% | 0.31% |
| 过去六个月 | -10.06% | 1.50% | -8.46% | 1.33% | -1.60% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | -8.82% | 1.48% | -7.94% | 1.32% | -0.88% | 0.16% |

泰康研究精选股票发起 C

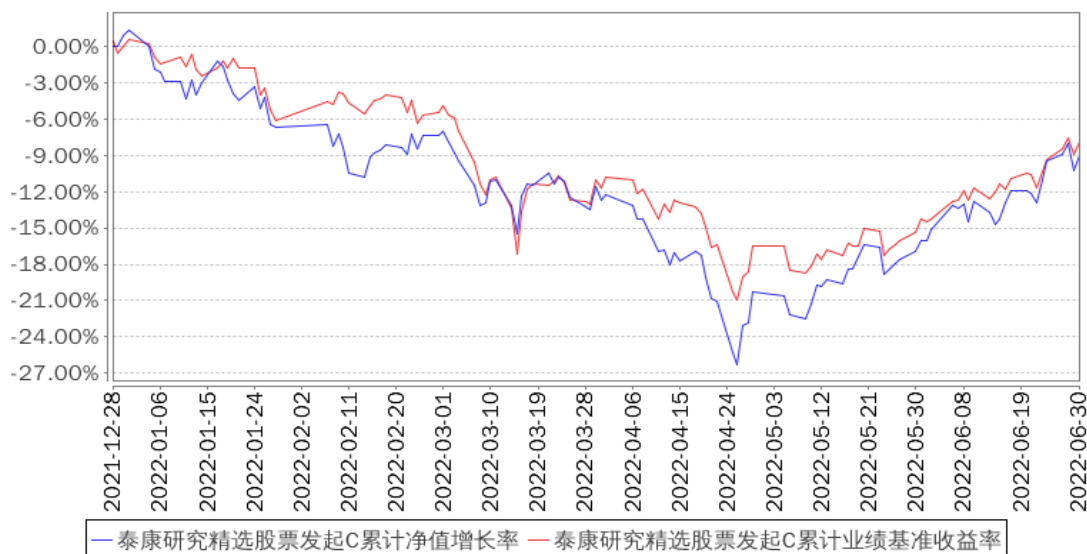
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 8.31% | 1.29% | 7.39% | 0.97% | 0.92% | 0.32% |
| 过去三个月 | 4.16% | 1.61% | 4.19% | 1.31% | -0.03% | 0.30% |
| 过去六个月 | -10.29% | 1.50% | -8.46% | 1.33% | -1.83% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.05% | 1.48% | -7.94% | 1.32% | -1.11% | 0.16% |

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

泰康研究精选股票发起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



泰康研究精选股票发起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 2021 年 12 月 28 日生效, 截止报告期末本基金未满一年。

2、按照本基金的基金合同规定, 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定, 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 | | |
| 陆建巍 | 本基金基金经理 | 2021 年 12 月 28 日 | - | 13 年 | 陆建巍于 2017 年 7 月加入泰康资产，现任公募事业部股票研究执行总监。2009 年 7 月至 2010 年 10 月在中信证券股份有限公司担任研究部分析师，2010 年 11 月至 2013 年 5 月在瑞银证券股份有限公司担任研究部分析师，2013 年 5 月至 2015 年 2 月在国泰君安证券股份有限公司担任研究部首席分析师，2015 年 3 月至 2017 年 7 月在广发基金管理有限公司担任研究发展部研究员。2021 年 12 月 13 日至今担任泰康招泰尊享一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。2021 年 12 月 28 日至今担任泰康研究精选股票型发起式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 and 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。

具体投资上，本基金在一季度快速增加仓位，在节奏控制上不够理想。板块配置方面，基本遵循高增长/估值性价比的原则，在经济强相关的消费，地产链板块和半导体，新能源为代表的成长板块均衡布局。在滞涨风险出现后，配置了部分原油，煤炭等资源品，部分对冲了市场风险。在第二季度的操作中，本基金采用基本面景气有限的原则，仓位配置于成长、资源和稳增长三个板块，在市场大幅下行时保持了组合中的光伏、新能源车、半导体设备等基本面有信心的板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康研究精选 A 基金份额净值为 0.9118 元，本报告期基金份额净值增长率为 -10.06%；截至本报告期末泰康研究精选 C 基金份额净值为 0.9095 元，本报告期基金份额净值增长率为 -10.29%；同期业绩比较基准增长率为 -8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，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。

对于权益市场，展望下半年，疫情对经济的抑制效果大幅减轻，地产各类因城施策政策频出，基建政策也开始强调工程进度，国内经济有望出现逐月环比改善的情况；相比之下，欧美的经济衰退迹象愈加明显，预计整体将呈现出内强外弱格局。

权益投资方面，我们整体对于下半年市场维持乐观，结构上，纠正五六月份基金配置锐度不够的问题，在环比改善更为明显的经济强相关板块（主要是地产链和基建链）加大配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者

利益最大化为最高准则。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§ 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

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：泰康研究精选股票型发起式证券投资基金

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 | 10,991,477.04 | 9,378,393.92 |
| 结算备付金 | | 440,579.45 | - |
| 存出保证金 | | 123,033.21 | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 93,101,639.99 | 72,032,911.54 |
| 其中：股票投资 | | 93,101,639.99 | 72,032,911.54 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 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 | - | 35,000,000.00 |
| 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 | | 3,226,935.16 | 2,654,572.84 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 792,356.65 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | -5,144.62 |
| 资产总计 | | 108,676,021.50 | 119,060,733.68 |
| 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 | | 1,014,642.45 | 588,244.01 |
| 应付赎回款 | | 148,120.73 | - |

| | | | |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | | 124,891.75 | 14,450.98 |
| 应付托管费 | | 20,815.32 | 2,408.50 |
| 应付销售服务费 | | 35,747.52 | 4,147.10 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 0.68 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 113,546.59 | 19,063.27 |
| 负债合计 | | 1,457,765.04 | 628,313.86 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 117,846,672.46 | 116,822,522.43 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -10,628,416.00 | 1,609,897.39 |
| 净资产合计 | | 107,218,256.46 | 118,432,419.82 |
| 负债和净资产总计 | | 108,676,021.50 | 119,060,733.68 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，泰康研究精选股票发起 A 基金份额净值 0.9118 元，基金份额总额 16,732,453.28 份；泰康研究精选股票发起 C 基金份额净值 0.9095 元，基金份额总额 101,114,219.18 份。泰康研究精选股票发起份额总额合计为 117,846,672.46 份。

6.2 利润表

会计主体：泰康研究精选股票型发起式证券投资基金

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 |
|-------------------|----------|--|
| 一、营业总收入 | | -11,040,735.32 |
| 1. 利息收入 | | 191,427.24 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 66,055.96 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 125,371.28 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -11,392,086.48 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -12,184,869.98 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 47,733.47 |
| 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 | 745,050.03 |
| 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 | 159,445.01 |
| 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 | 478.91 |
| 减：二、营业总支出 | | 1,189,603.21 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 763,744.06 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 127,290.73 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 219,024.25 |
| 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 | | 0.11 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 79,544.06 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -12,230,338.53 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -12,230,338.53 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | -12,230,338.53 |

注：本基金合同生效日为 2021 年 12 月 28 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰康研究精选股票型发起式证券投资基金

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） | 116,822,522.43 | - | 1,609,897.39 | 118,432,419.82 |
| 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） | 116,822,522.43 | - | 1,609,897.39 | 118,432,419.82 |
| 三、本期增减变动额 | 1,024,150.03 | - | -12,238,313.39 | -11,214,163.36 |

| | | | | |
|--|----------------|---|----------------|----------------|
| (减少以“-”号填列) | | | | |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -12,230,338.53 | -12,230,338.53 |
| (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) | 1,024,150.03 | - | -7,974.86 | 1,016,175.17 |
| 其中：1. 基金申购款 | 8,415,978.83 | - | -1,253,795.90 | 7,162,182.93 |
| 2. 基金赎回款 | -7,391,828.80 | - | 1,245,821.04 | -6,146,007.76 |
| (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) | 117,846,672.46 | - | -10,628,416.00 | 107,218,256.46 |

注：本基金合同生效日为 2021 年 12 月 28 日，无上年度可比期间数据。

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康研究精选股票型发起式证券投资基金（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[2021]3450号《关于准予泰康研究精选股票型发起式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《泰康研究精选股票型发起式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 116,784,947.44 元，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字第 2101325 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康研究精选股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 116,822,522.43 份基金份额，其中认购资金利息

折合 37,574.99 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（以下简称“泰康资产”），基金托管人为国信证券股份有限公司（以下简称“国信证券”）。

根据经中国证监会备案的《泰康研究精选股票型发起式证券投资基金基金合同》和《泰康研究精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购 / 申购费用、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购 / 申购基金时收取认购 / 申购费用，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购基金份额时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，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。计算公式为计算日该类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额余额总数。投资者在认购/申购基金份额时可自行选择基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康研究精选股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票（包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、股指期货、国债期货、债券资产（包括国债、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、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单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：本基金对股票的投资比例占基金资产的 80%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*80%+恒生指数收益率*10%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，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净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间和 2021 年 12 月 28 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

自 2021 年 12 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间：

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金持有的股票投资和债券投资 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。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。

自 2022 年 1 月 1 日起：

(a) 金融资产的分类

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

本基金持有的股票投资和债券投资 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。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。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被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，

分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

自 2021 年 12 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间：

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 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；

- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值

- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

自 2022 年 1 月 1 日起：

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债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。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为企面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导

致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失,是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月,则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失,是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款,本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外,本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备,对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备:

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险;或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化,本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失,由此形成的损失准备的增加或转回金额,应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产,损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回,则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是,被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的,作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具,在估值日有报价的,除会计准则规定的情况外,将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,对报价进行调整,确定公允价值。

与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益 按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。本基金的交易费用于进行股票、债券、权证 等交易发生时按照确定的金额确认并计入

投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的收入差异较小的可采用合同利率。

公允价值变动损益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动（包括于估值日采用合同约定的估值汇率将外币折算为人民币所产生的折算差额）形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的支出差异较小的可采用合同利率。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别每份基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发〔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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中债金融估值中心有限公司独立提供。

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

本基金自2022年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第23号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第24号——套期会计（修订）》及《企业会计准则第37号——金融工具列报（修订）》（统称“新金融工具准则”）和2022年中国证监会发布的修订的《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〉》。

（a）新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于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》，本基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《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》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 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 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收利息，对应的账面价值分别为人民币 9,378,393.92 元、35,000,000.00 元、2,654,572.84 元、-5,144.62 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产、应收证券清算款和其他资产-应收利息，对应的账面价值分别为人民币 9,386,399.99 元、34,986,849.31 元、2,654,572.84 元、0 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 72,032,911.54 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的

金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 72,032,911.54 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、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，对应的账面价值分别为人民币 588,244.01 元、14,450.98 元、2,408.50 元、4,147.10 元、19,063.27 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 588,244.01 元、14,450.98 元、2,408.50 元、4,147.10 元、19,063.27 元。

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、买入返售金融资产和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，本基金按照新金融工具准则，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、买入返售金融资产和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。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2014] 81 号文《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 [2016] 127 号文《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 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好

调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局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] 140 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下简称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴

20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。对于基金通过沪港通/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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 | 10,991,477.04 |
| 等于：本金 | 10,988,257.31 |
| 加：应计利息 | 3,219.73 |
| 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 | 10,991,477.04 |

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 | 91,303,798.22 | - | 93,101,639.99 | 1,797,841.77 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 91,303,798.22 | - | 93,101,639.99 | 1,797,841.77 |

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

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

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 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 34,402.53 |
| 其中：交易所市场 | 34,402.53 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 79,144.06 |
| 合计 | 113,546.59 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰康研究精选股票发起 A

| 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 | 16,246,175.77 | 16,246,175.77 |
| 本期申购 | 659,097.14 | 659,097.14 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -172,819.63 | -172,819.63 |
| 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 | 16,732,453.28 | 16,732,453.28 |

泰康研究精选股票发起 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 | 100,576,346.66 | 100,576,346.66 |
| 本期申购 | 7,756,881.69 | 7,756,881.69 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -7,219,009.17 | -7,219,009.17 |
| 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 | 101,114,219.18 | 101,114,219.18 |

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2021 年 12 月 10 日至 2021 年 12 月 24 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 116,822,522.43 元，其中 A 类基金有效净认购资金为 16,246,175.77 元，C 类基金有效净认购资金为 100,576,346.66 元。根据《泰康研究精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》和《泰康研究精选股票型发起式证券投资基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购 A 类基金资金产生的利息收入 3,825.43 元和认购 C 类基金资金产生的利息收入 33,749.56 元在本基金成立后，分别折算为 3,825.43 份 A 类基金份额和 33,749.56 份 C 类基金份额，划入基金份额持有人账户。

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

泰康研究精选股票发起 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|------------|---------------|
| 本期期初 | -3,386.62 | 227,850.54 | 224,463.92 |
| 本期利润 | -1,697,459.50 | 42,103.01 | -1,655,356.49 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -48,723.02 | 3,527.01 | -45,196.01 |
| 其中：基金申购款 | -61,422.16 | -17,678.15 | -79,100.31 |
| 基金赎回款 | 12,699.14 | 21,205.16 | 33,904.30 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -1,749,569.14 | 273,480.56 | -1,476,088.58 |

泰康研究精选股票发起 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|--------------|----------------|
| 本期期初 | -25,112.75 | 1,410,546.22 | 1,385,433.47 |
| 本期利润 | -10,692,324.04 | 117,342.00 | -10,574,982.04 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -67,514.46 | 104,735.61 | 37,221.15 |
| 其中：基金申购款 | -678,712.75 | -495,982.84 | -1,174,695.59 |
| 基金赎回款 | 611,198.29 | 600,718.45 | 1,211,916.74 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -10,784,951.25 | 1,632,623.83 | -9,152,327.42 |

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 | 53,553.75 |

| | |
|-----------|-----------|
| 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 | 11,382.17 |
| 其他 | 1,120.04 |
| 合计 | 66,055.96 |

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 | -12,184,869.98 |
| 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 | -12,184,869.98 |

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 | 99,023,677.52 |
| 减：卖出股票成本总额 | 111,009,961.51 |
| 减：交易费用 | 198,585.99 |
| 买卖股票差价收入 | -12,184,869.98 |

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 | 26.41 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 47,707.06 |
| 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 | 47,733.47 |

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 | 270,734.53 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 223,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 27.36 |
| 减：交易费用 | 0.11 |
| 买卖债券差价收入 | 47,707.06 |

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 | 745,050.03 |
| 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 | 745,050.03 |

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 | 159,445.01 |
| 股票投资 | 159,445.01 |
| 债券投资 | - |
| 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 | 159,445.01 |

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 | 329.27 |
| 基金转换费收入 | 149.64 |
| 合计 | 478.91 |

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。

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 | 19,636.69 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 其他 | 400.00 |
| 合计 | 79,544.06 |

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 |
| 国信证券股份有限公司（“国信证券”） | 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，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 |
|-----------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 763,744.06 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,954.39 |

注：支付基金管理人泰康资产管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 127,290.73 |

注：支付基金托管人国信证券的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X0.25%/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 | | |
| | 泰康研究精选股票发起 A | 泰康研究精选股票发起 C | 合计 |
| 泰康资产管理有限公司 | - | 214,586.21 | 214,586.21 |
| 国信证券 | - | 1.81 | 1.81 |
| 合计 | - | 214,588.02 | 214,588.02 |

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 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰康资产管理有限责任公司，再由泰康资产管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：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 X0.50%/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，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，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，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**

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 本期 |
|-----------------------------|----------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| | 泰康研究精选股票发起 A | 泰康研究精选股票发起 C |
| 基金合同生效日（2021年12月28日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 9,901,870.18 | 100,018.88 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 9,901,870.18 | 100,018.88 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 59.1776% | 0.0989% |

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额；

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

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，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

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 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 国信证券股份有限公司 | 10,991,477.04 | 53,553.75 |

注：基金的银行存款由基金托管人国信证券存放在交通银行，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，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，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 |
| 600938 | 中国海油 | 2022 年 4 月 14 日 | 6 个月 | 新股锁定期流通受限 | 10.80 | 15.86 | 49,003 | 529,232.40 | 777,187.58 | - |

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》，本基金可作为特定投资者，所认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，所认购的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其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%。此外，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,作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者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、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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要为股票投资、债券和货币市场工具等。本基金除了需要承担与境内证券投资基金类似的信用风险、流动性风险、市场风险以外，还面临汇率风险、香港市场风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 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 | 10,991,477.04 | - | - | - | 10,991,477.04 |
| 结算备付金 | 440,579.45 | - | - | - | 440,579.45 |
| 存出保证金 | 123,033.21 | - | - | - | 123,033.21 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 93,101,639.99 | 93,101,639.99 |
| 应收申购款 | - | - | - | 792,356.65 | 792,356.65 |
| 应收清算款 | - | - | - | 3,226,935.16 | 3,226,935.16 |
| 资产总计 | 11,555,089.70 | - | - | 97,120,931.80 | 108,676,021.50 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 148,120.73 | 148,120.73 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 124,891.75 | 124,891.75 |
| 应付托管费 | - | - | - | 20,815.32 | 20,815.32 |
| 应付清算款 | - | - | - | 1,014,642.45 | 1,014,642.45 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 35,747.52 | 35,747.52 |
| 应交税费 | - | - | - | 0.68 | 0.68 |
| 其他负债 | - | - | - | 113,546.59 | 113,546.59 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,457,765.04 | 1,457,765.04 |
| 利率敏感度缺口 | 11,555,089.70 | - | - | 95,663,166.76 | 107,218,256.46 |
| 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 | 9,378,393.92 | - | - | - | 9,378,393.92 |

| | | | | | |
|----------|---------------|---|---|---------------|----------------|
| 交易性金融资产 | - | - | - | 72,032,911.54 | 72,032,911.54 |
| 买入返售金融资产 | 35,000,000.00 | - | - | - | 35,000,000.00 |
| 应收清算款 | - | - | - | 2,654,572.84 | 2,654,572.84 |
| 其他资产 | - | - | - | -5,144.62 | -5,144.62 |
| 资产总计 | 44,378,393.92 | - | - | 74,682,339.76 | 119,060,733.68 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 14,450.98 | 14,450.98 |
| 应付托管费 | - | - | - | 2,408.50 | 2,408.50 |
| 应付清算款 | - | - | - | 588,244.01 | 588,244.01 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 4,147.10 | 4,147.10 |
| 其他负债 | - | - | - | 19,063.27 | 19,063.27 |
| 负债总计 | - | - | - | 628,313.86 | 628,313.86 |
| 利率敏感度缺口 | 44,378,393.92 | - | - | 74,054,025.90 | 118,432,419.82 |

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 | | |
| | | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | 相关风险变量的变动 | 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% | 0.00 | 0.00 |
| | 市场利率下调 0.25% | 0.00 | 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

于 2022 年 06 月 30 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 4,881,820.00 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 4,881,820.00 元。

假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 48,818.20 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 -48,818.20 元。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | | |
|---------------|---------------------|--------------|----------------|--------------|
| | 美元 折合人民币元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 4,881,820.00 | - | 4,881,820.00 |
| 资产合计 | - | 4,881,820.00 | - | 4,881,820.00 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 4,881,820.00 | - | 4,881,820.00 |
| 项目 | 上年度末 2021年12月31日 | | | |
| | 美元 折合人民币元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 资产合计 | - | - | - | - |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | - | - | - |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| | | | |
|-----------|--|-------------------|---|
| 假设 | 假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响 | | |
| 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 | 市场汇率上升 1% | 48,818.20 | - |
| | 市场汇率下降 1% | -48,818.20 | - |

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。本基金对股票的投资比例占基金资产的 80%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 | 93,101,639.99 | 86.83 | 72,032,911.54 | 60.82 |
| 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 | 93,101,639.99 | 86.83 | 72,032,911.54 | 60.82 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 | 92,324,452.41 | 72,032,911.54 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | 777,187.58 | - |
| 合计 | 93,101,639.99 | 72,032,911.54 |

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 | 93,101,639.99 | 85.67 |
| | 其中：股票 | 93,101,639.99 | 85.67 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 11,432,056.49 | 10.52 |
| 8 | 其他各项资产 | 4,142,325.02 | 3.81 |
| 9 | 合计 | 108,676,021.50 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 4,881,820.00 元，占期末资产净值比例为 4.55%

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 | 2,028,409.00 | 1.89 |
| B | 采矿业 | 4,797,577.58 | 4.47 |
| C | 制造业 | 71,349,284.41 | 66.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 5,571,856.00 | 5.20 |
| F | 批发和零售业 | 1,646,568.00 | 1.54 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,242,201.00 | 1.16 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,583,924.00 | 1.48 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 88,219,819.99 | 82.28 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|--------------|--------------|
| A 基础材料 | - | - |
| B 消费者非必需品 | 1,245,600.00 | 1.16 |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | 1,504,300.00 | 1.40 |
| G 工业 | - | - |
| H 信息技术 | 2,131,920.00 | 1.99 |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 4,881,820.00 | 4.55 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 16,800 | 8,971,200.00 | 8.37 |
| 2 | 002371 | 北方华创 | 15,000 | 4,156,800.00 | 3.88 |
| 3 | 601012 | 隆基绿能 | 46,220 | 3,079,638.60 | 2.87 |
| 4 | 002594 | 比亚迪 | 8,700 | 2,901,363.00 | 2.71 |
| 5 | 000683 | 远兴能源 | 248,200 | 2,608,582.00 | 2.43 |
| 6 | 600309 | 万华化学 | 23,500 | 2,279,265.00 | 2.13 |
| 7 | 002812 | 恩捷股份 | 8,900 | 2,229,005.00 | 2.08 |
| 8 | 601865 | 福莱特 | 57,200 | 2,179,320.00 | 2.03 |
| 9 | 03800 | 协鑫科技 | 658,000 | 2,131,920.00 | 1.99 |
| 10 | 603501 | 韦尔股份 | 12,300 | 2,128,269.00 | 1.98 |
| 11 | 300751 | 迈为股份 | 4,320 | 2,120,688.00 | 1.98 |
| 12 | 603456 | 九洲药业 | 39,900 | 2,062,830.00 | 1.92 |
| 13 | 002714 | 牧原股份 | 36,700 | 2,028,409.00 | 1.89 |
| 14 | 002318 | 久立特材 | 126,200 | 2,017,938.00 | 1.88 |
| 15 | 600988 | 赤峰黄金 | 126,000 | 2,009,700.00 | 1.87 |
| 16 | 601800 | 中国交建 | 215,200 | 1,997,056.00 | 1.86 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 17 | 601390 | 中国中铁 | 322,800 | 1,981,992.00 | 1.85 |
| 18 | 002129 | TCL 中环 | 32,200 | 1,896,258.00 | 1.77 |
| 19 | 300373 | 扬杰科技 | 26,000 | 1,852,500.00 | 1.73 |
| 20 | 600438 | 通威股份 | 30,300 | 1,813,758.00 | 1.69 |
| 21 | 000568 | 泸州老窖 | 7,300 | 1,799,742.00 | 1.68 |
| 22 | 601636 | 旗滨集团 | 132,700 | 1,691,925.00 | 1.58 |
| 23 | 688200 | 华峰测控 | 4,706 | 1,677,218.40 | 1.56 |
| 24 | 600861 | 北京城乡 | 75,600 | 1,646,568.00 | 1.54 |
| 25 | 600256 | 广汇能源 | 156,000 | 1,644,240.00 | 1.53 |
| 26 | 300861 | 美畅股份 | 17,500 | 1,622,075.00 | 1.51 |
| 27 | 300896 | 爱美客 | 2,700 | 1,620,027.00 | 1.51 |
| 28 | 002179 | 中航光电 | 25,480 | 1,613,393.60 | 1.50 |
| 29 | 000786 | 北新建材 | 46,200 | 1,599,444.00 | 1.49 |
| 30 | 601668 | 中国建筑 | 299,400 | 1,592,808.00 | 1.49 |
| 31 | 688019 | 安集科技 | 7,454 | 1,587,105.68 | 1.48 |
| 32 | 601888 | 中国中免 | 6,800 | 1,583,924.00 | 1.48 |
| 33 | 603801 | 志邦家居 | 58,300 | 1,572,934.00 | 1.47 |
| 34 | 002531 | 天顺风能 | 93,100 | 1,535,219.00 | 1.43 |
| 35 | 603799 | 华友钴业 | 15,860 | 1,516,533.20 | 1.41 |
| 36 | 02269 | 药明生物 | 24,500 | 1,504,300.00 | 1.40 |
| 37 | 300443 | 金雷股份 | 32,800 | 1,495,024.00 | 1.39 |
| 38 | 603218 | 日月股份 | 54,800 | 1,391,920.00 | 1.30 |
| 39 | 03690 | 美团-W | 7,500 | 1,245,600.00 | 1.16 |
| 40 | 002063 | 远光软件 | 176,700 | 1,242,201.00 | 1.16 |
| 41 | 600141 | 兴发集团 | 27,200 | 1,196,528.00 | 1.12 |
| 42 | 688388 | 嘉元科技 | 14,060 | 1,193,272.20 | 1.11 |
| 43 | 002241 | 歌尔股份 | 34,900 | 1,172,640.00 | 1.09 |
| 44 | 600938 | 中国海油 | 70,003 | 1,143,637.58 | 1.07 |
| 45 | 603191 | 望变电气 | 49,100 | 1,119,480.00 | 1.04 |
| 46 | 300124 | 汇川技术 | 15,900 | 1,047,333.00 | 0.98 |
| 47 | 002025 | 航天电器 | 14,200 | 991,444.00 | 0.92 |
| 48 | 605117 | 德业股份 | 3,420 | 957,223.80 | 0.89 |
| 49 | 603297 | 永新光学 | 5,400 | 603,234.00 | 0.56 |
| 50 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.03 |
| 51 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.01 |

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 1 | 601636 | 旗滨集团 | 3,424,297.59 | 2.89 |
| 2 | 000683 | 远兴能源 | 2,760,786.00 | 2.33 |
| 3 | 000915 | 华特达因 | 2,286,172.00 | 1.93 |
| 4 | 601233 | 桐昆股份 | 2,267,103.00 | 1.91 |
| 5 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 2,264,938.00 | 1.91 |
| 6 | 601390 | 中国中铁 | 2,222,491.00 | 1.88 |
| 7 | 601800 | 中国交建 | 2,204,696.00 | 1.86 |
| 8 | 002318 | 久立特材 | 2,183,080.00 | 1.84 |
| 9 | 600309 | 万华化学 | 2,182,390.00 | 1.84 |
| 10 | 603501 | 韦尔股份 | 2,114,394.00 | 1.79 |
| 11 | 600988 | 赤峰黄金 | 2,075,353.00 | 1.75 |
| 12 | 688200 | 华峰测控 | 2,066,789.56 | 1.75 |
| 13 | 002812 | 恩捷股份 | 2,044,411.00 | 1.73 |
| 14 | 06185 | 康希诺生物 | 1,980,108.63 | 1.67 |
| 15 | 002714 | 牧原股份 | 1,978,128.00 | 1.67 |
| 16 | 600754 | 锦江酒店 | 1,930,470.00 | 1.63 |
| 17 | 300144 | 宋城演艺 | 1,928,305.00 | 1.63 |
| 18 | 00883 | 中国海洋石油 | 1,169,091.50 | 0.99 |
| 18 | 600938 | 中国海油 | 756,032.40 | 0.64 |
| 19 | 301073 | 君亭酒店 | 1,921,270.68 | 1.62 |
| 20 | 600256 | 广汇能源 | 1,870,783.00 | 1.58 |

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 | 000915 | 华特达因 | 3,022,027.00 | 2.55 |
| 2 | 300294 | 博雅生物 | 2,689,179.73 | 2.27 |
| 3 | 000921 | 海信家电 | 2,665,910.00 | 2.25 |
| 4 | 688202 | 美迪西 | 2,601,355.64 | 2.20 |
| 5 | 688639 | 华恒生物 | 2,220,784.50 | 1.88 |
| 6 | 000893 | 亚钾国际 | 2,219,047.00 | 1.87 |
| 7 | 01797 | 新东方在线 | 2,043,061.56 | 1.73 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 2,022,052.00 | 1.71 |
| 9 | 600754 | 锦江酒店 | 2,015,899.00 | 1.70 |
| 10 | 603896 | 寿仙谷 | 2,015,600.20 | 1.70 |
| 11 | 06185 | 康希诺生物 | 1,988,214.36 | 1.68 |
| 12 | 300911 | 亿田智能 | 1,906,543.00 | 1.61 |
| 13 | 300144 | 宋城演艺 | 1,861,039.00 | 1.57 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 301073 | 君亭酒店 | 1,810,979.16 | 1.53 |
| 15 | 600132 | 重庆啤酒 | 1,777,791.00 | 1.50 |
| 16 | 603290 | 斯达半导 | 1,730,167.90 | 1.46 |
| 17 | 000792 | 盐湖股份 | 1,727,236.00 | 1.46 |
| 18 | 603005 | 晶方科技 | 1,709,282.00 | 1.44 |
| 19 | 603019 | 中科曙光 | 1,681,145.00 | 1.42 |
| 20 | 300014 | 亿纬锂能 | 1,661,011.00 | 1.40 |

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 | 131,919,244.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 99,023,677.52 |

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

本基金本报告期末未持有债券

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

本基金本报告期末未持有债券

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票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 | 123,033.21 |
| 2 | 应收清算款 | 3,226,935.16 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 792,356.65 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,142,325.02 |

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 (%) |
| 泰康研究精选股票 发起 A | 244 | 68,575.63 | 9,901,870.18 | 59.18 | 6,830,583.10 | 40.82 |
| 泰康研究精选股票 发起 C | 3,428 | 29,496.56 | 3,100,018.88 | 3.07 | 98,014,200.30 | 96.93 |
| 合计 | 3,592 | 32,808.09 | 13,001,889.06 | 11.03 | 104,844,783.40 | 88.97 |

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 | 泰康研究精选股票发起 A | 606,451.62 | 3.6244 |
| | 泰康研究精选股票发起 C | 804,452.78 | 0.7956 |
| | 合计 | 1,410,904.40 | 1.1972 |

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 | 泰康研究精选股票发起 A | 10~50 |
| | 泰康研究精选股票发起 C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开 放式基金 | 泰康研究精选股票发起 A | 0 |
| | 泰康研究精选股票发起 C | 10~50 |
| | 合计 | 10~50 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,001,889.06 | 8.49 | 10,001,889.06 | 8.49 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,001,889.06 | 8.49 | 10,001,889.06 | 8.49 | - |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 泰康研究精选股票发起 A | 泰康研究精选股票发起 C |
|---------------------------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日（2021 年 12 月 28 日）基金份额总额 | 16,246,175.77 | 100,576,346.66 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 16,246,175.77 | 100,576,346.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 659,097.14 | 7,756,881.69 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 172,819.63 | 7,219,009.17 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 16,732,453.28 | 101,114,219.18 |

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

2、本基金合同生效日为 2021 年 12 月 28 日，截至报告期末不满一年。

§ 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未出现重大人事变动。基金托管人于 2022 年 4 月 14 日发布公告，国信证券股份有限公司资产托管部总经理胡忠孝因工作安排离任，孙英担任国信证券股份有限公司资产托管部副总经理（主持工作）。

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

本基金聘任毕马威华振会计师事务所（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 (%) | |
| 中金 | 3 | 229,971,447.66 | 100.00 | 63,441.66 | 100.00 | - |

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 3 个交易单元，为中金公司上海、深圳、北京证券交易所交易单元各 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 (%) |
| 中金 | 270,731.40 | 100.00 | 1,203,000,000.00 | 100.00 | - | - |

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 | 《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日 | 2022 年 01 月 25 日 |

| | | | |
|----|--|---|------------------|
| | 开放申购赎回等交易类业务的提示性公告 | 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 | |
| 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 | 2022 年 02 月 16 日 |
| 6 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金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 | 《中国证券报》；《上 | 2022 年 03 月 11 日 |

| | | | |
|----|--|---|------------------|
| | 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 | 海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | |
| 13 | 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 |
| 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 | 关于泰康研究精选股票型发起式证券投资基金参加部分销售机构费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》；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 24 日 |
| 18 | 泰康研究精选股票型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 《上海证券报》；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 24 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 |
| 20 | 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 |
| 21 | 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 | 2022 年 04 月 02 日 |

| | | | |
|----|---|---|------------------|
| | | 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 |
| 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 |
| 24 | 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基金管理人网站 | 2022 年 04 月 18 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 |
| 26 | 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 |
| 27 | 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 |
| 28 | 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 |
| 29 | 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 |
| 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腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并 | 《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中 | 2022 年 05 月 18 日 |

| | | | |
|----|--|---|------------------|
| | 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 | |
| 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 |
| 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 |
| 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》；《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 26 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 |
| 35 | 泰康资产管理有限责任公司关于旗下基金重大关联交易事项的公告 | 《上海证券报》；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 |
| 36 | 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 |
| 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 |
| 38 | 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 |
| 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 | 2022 年 06 月 10 日 |

| | | | |
|----|---|---|------------------|
| | | 网站及基金管理人网站 | |
| 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 |
| 41 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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 |
| 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 |
| 43 | 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 23 日 |
| 44 | 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

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。

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研究精选股票型发起式证券投资基金注册的文件;
- (二) 《泰康研究精选股票型发起式证券投资基金基金合同》;
- (三) 《泰康研究精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》;
- (四) 《泰康研究精选股票型发起式证券投资基金托管协议》;
- (五) 《泰康研究精选股票型发起式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