

泰康申润一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 20 日

§1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 19 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 2023 年 4 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰康申润一年持有期混合
基金主代码	009448
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 30 日
报告期末基金份额总额	45,680,355.82 份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过合理配置大类资产和精选投资标的，力求实现基金资产的长期稳健增值，为投资者提供稳健的长期投资工具。
投资策略	<p>本基金在严格控制风险的基础上，通过合理配置大类资产和精选投资标的，力求实现基金资产的长期稳健增值。在具体投资上通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。</p> <p>债券投资方面，本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。在确定组合久期的基础上，运用统计和数量分析技术、对市场利率期限结构历史数据进行分析检验和情景测试，并综合考虑债券市场微观因素，形成对债券收益率曲线形态及其发展趋势的判断。信用策略方面，利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估，重点分析发债主体的行业发展前景、市场地位、公司治理、财务质量、融资目的等要素，综合评价其信用等级，分析违约风险以及合理信用利差水平，识别投</p>

	<p>资价值。</p> <p>股票投资方面，本基金在股票基本面研究的基础上，同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，将影响上市公司基本面和股价的增长类因素、估值类因素、盈利类因素、财务风险等因素进行综合分析，在定性分析的同时结合量化分析方法，精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的国内 A 股及内地与香港股票市场交易互联互通机制下的港股投资标的股票，以此构建股票组合。本基金通过对国内 A 股市场和港股市场跨市场的投资，来达到分散投资风险、增强基金整体收益的目的。</p>	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债新综合全价（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。本基金投资范围涉及法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，即本基金是一只涉及跨境证券投资的基金。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。	
基金管理人	泰康基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰康申润一年持有期混合 A	泰康申润一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	009448	009449
报告期末下属分级基金的份额总额	37,676,452.41 份	8,003,903.41 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	
	泰康申润一年持有期混合 A	泰康申润一年持有期混合 C
1. 本期已实现收益	-12,382.31	-13,273.52
2. 本期利润	91,737.39	5,580.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0023	0.0007
4. 期末基金资产净值	39,627,135.23	8,267,690.93
5. 期末基金份额净值	1.0518	1.0330

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）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

泰康申润一年持有期混合 A

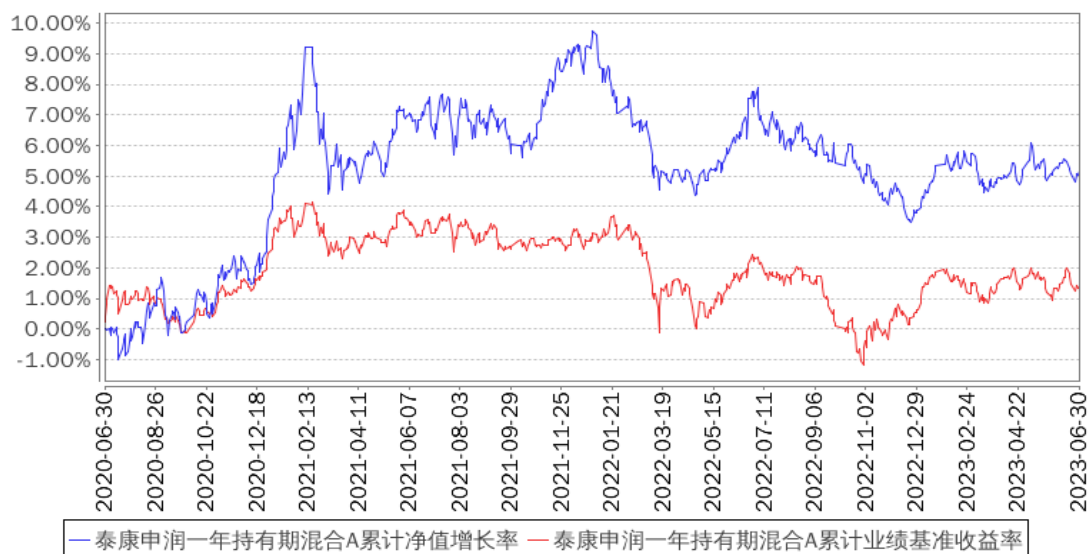
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.21%	0.16%	-0.12%	0.13%	0.33%	0.03%
过去六个月	1.24%	0.16%	0.77%	0.14%	0.47%	0.02%
过去一年	-2.39%	0.19%	-0.92%	0.17%	-1.47%	0.02%
过去三年	5.18%	0.27%	1.18%	0.18%	4.00%	0.09%
自基金合同生效起至今	5.18%	0.27%	1.40%	0.18%	3.78%	0.09%

泰康申润一年持有期混合 C

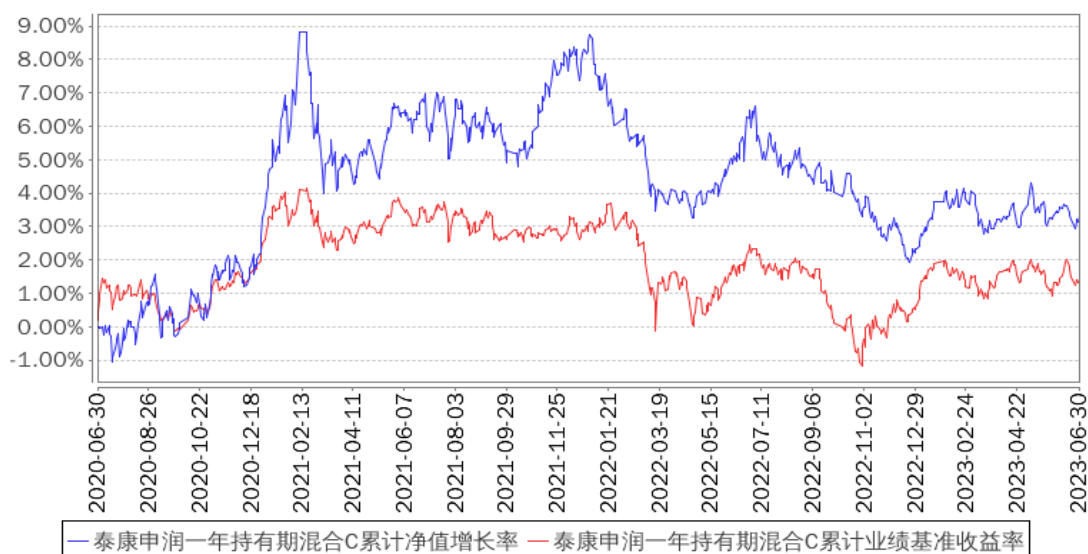
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.07%	0.16%	-0.12%	0.13%	0.19%	0.03%
过去六个月	0.95%	0.16%	0.77%	0.14%	0.18%	0.02%
过去一年	-2.97%	0.19%	-0.92%	0.17%	-2.05%	0.02%
过去三年	3.30%	0.27%	1.18%	0.18%	2.12%	0.09%
自基金合同生效起至今	3.30%	0.27%	1.40%	0.18%	1.90%	0.09%

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

泰康申润一年持有期混合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



泰康申润一年持有期混合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 2020 年 06 月 30 日生效。

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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
陈怡	本基金基金经理	2020年6月30日	-	11年	陈怡于 2016 年 5 月加入泰康公募，现任泰康基金股票基金经理。曾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、行业投资经理等职务。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。
任慧娟	本基金基金经理	2020年6月30日	-	16年	任慧娟于 2015 年 8 月加入泰康公募，现任泰康基金固定收益基金经理。曾任阳光财产保险公司资产管理中心固定收益投资部高级投资经理。2015 年 12 月 9 日至 2022 年 10 月 26 日担任泰康新意保货币市场基金基金经理。2016 年 5 月 9 日至今担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 7 月 13 日至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 24 日至今担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 21 日至 2019 年 5 月 8 日担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 8 日至今担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康申润一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2022 年 8 月 1 日至今担任泰康丰盛纯债一年定期开放债券型发起式

					证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 20 日至今担任泰康安泓纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 28 日至今担任泰康丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
马敦超	本基金基金经理	2022 年 10 月 14 日	-	8 年	马敦超于 2022 年 5 月加入泰康公募，现任泰康基金股票基金经理。曾任中粮集团营养健康研究院战略与市场研究部战略规划与项目管理专员、哈纳斯新能源集团发展规划部业务总监、副部长和总裁助理、阳光资产管理股份有限公司权益投资一部高级投资经理等职务。2022 年 10 月 14 日至今担任泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康申润一年持有期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的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济在 2023 年二季度环比上有所走弱，内生增长动能不足的问题逐步凸显。出口在一季

度的超预期表现之后，由于海外的去库存压力转为负增长；投资则受限于地产形势和民企投资意愿不足。二季度比较突出的因素在于居民消费倾向有所下降，在收入预期下降、年轻人失业率高企的环境下，居民部门信心不足。在这种环境下，社融周期边际走弱，汇率有所贬值，物价有所走低，库存主动去化。

债券市场在二季度呈现出牛市的走势，基本面环比动能的走弱是较为关键的原因，存款利率下调、6 月份央行降息，也进一步促进了收益率走低。在降息之后，市场进入到政策博弈阶段，收益率出现一定的反复，但总体波动空间不大，汇率贬值对利率的制约也较为有限。10Y 国债在一季度末的 2.85%左右下行到 2.65%附近，围绕新的 MLF 利率窄幅波动。

固收投资方面，本基金在报告期内以获取持有期收益为主要目标，在控制组合久期水平的基础上，根据市场形势调整利率债、信用债及商业银行金融债的配置比例，维持较高的杠杆水平。信用债方面，精挑细选优质主体，严防信用尾部风险。

权益市场方面，回顾上半年，一季度疫情高峰冲击过后国内经济运行良好，生产需求企稳回升，制造业 PMI 均在 51 的上方运行，一季度国内生产总值同比增长 4.5%，环比增长 2.2%，居民收入持续增加，市场预期明显改善。进入二季度，疫情解封红利走向终结，地产销售回落，消费和投资需求不旺，信心不强，叠加海外需求回落拖累国内生产，4 月制造业 PMI 快速回落至 49.2，5 月跌至 48.8，6 月略微反弹至 49.0，但依然处于荣枯线以下。权益市场方面，1 月和 2 月市场预期强信心足，股市整体偏强运行，赚钱效应良好，3 月初的两会设定经济增长年度目标为 5%左右，将高质量发展放到更为重要的位置，市场对经济总量的预期开始转弱，此后顺周期行业持续下跌，TMT 相关的主题投资活跃，数字要素、CHATGPT、人形机器人等主题陆续成为市场热点。此外，以社会主义特色估值体系为核心特征的中特估标的也有着超预期的出色表现，充分证明深度价值投资在 A 股也有可行性甚至阶段性的优越性。整体而言，在上半年成长行业表现明显更优，如通信、传媒和计算机等，而地产、建材、化工和煤炭等周期行业跌幅较大，电新、食品和医药等过去的热门赛道也出现不同程度的下跌，这么巨大的分化现象为近几年罕见。我们认为背后原因主要有二个，第一，上半年经济预期由强转弱，经济现实也由弱转强再转弱，库存周期主动去库存阶段尚未结束，工业企业盈利尚未见底，顺周期行业缺少基本面支撑，而相比之下，TMT 行业出现人工智能这样强劲的全球产业趋势；第二，上半年股票市场缺少增量资金，存量博弈现象严重，进入新热门赛道的资金大多来自于存量持仓的减持，市场难免冷热并存，一半是火焰一半是海水，“热门”行业上涨是建立在“冷门”行业下跌的基础上，期间尽管不少的优质公司出现明显超跌，但也没有出现像样的反弹。展望下半年，股票市场震荡结构化的行情和资金存量博弈的现象预计仍将延续，我们会依旧保持对国内经济的信心，并尽可能保持耐心和定力，坚持将超

跌和低估值的行业和个股作为获取绝对收益的主要阵地。

权益操作方面，二季度以来我们延续追求绝对收益和喜好低估值的投资理念，减仓化工、交运等顺周期行业，并减少权益组合对港股的敞口，加仓以扎实的低估值和稳定的高派息为特征的金融和能源股，目前产品权益仓位保持相对低位，其中有二成多仓位为港股超低估值高派息的标的。后市我们将继续坚持现有的投资理念，希望在今年波动大、轮换快的权益市场中获得低波动的绝对收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康申润一年持有期混合 A 基金份额净值为 1.0518 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.21%；截至本报告期末泰康申润一年持有期混合 C 基金份额净值为 1.0330 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.07%；同期业绩比较基准增长率为-0.12%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2023 年 5 月 31 日至 2023 年 6 月 30 日。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,126,432.00	8.46
	其中：股票	5,126,432.00	8.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	55,015,642.94	90.76
	其中：债券	55,015,642.94	90.76
	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	454,332.02	0.75
8	其他资产	18,734.72	0.03
9	合计	60,615,141.68	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 1,455,650.00 元，占期末资产净值比例为 3.04%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	167,348.00	0.35
C	制造业	1,111,061.00	2.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	383,844.00	0.80
E	建筑业	365,638.00	0.76
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	1,642,891.00	3.43
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	-	-
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	3,670,782.00	7.66

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	460,190.00	0.96
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	420,950.00	0.88
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	177,150.00	0.37
J 公用事业	233,660.00	0.49
K 房地产	163,700.00	0.34
合计	1,455,650.00	3.04

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	177,300	625,869.00	1.31
2	601398	工商银行	107,100	516,222.00	1.08
3	600519	贵州茅台	300	507,300.00	1.06
4	601939	建设银行	80,000	500,800.00	1.05
5	600426	华鲁恒升	14,600	447,198.00	0.93
6	600900	长江电力	17,400	383,844.00	0.80
7	601668	中国建筑	63,700	365,638.00	0.76
8	02899	紫金矿业	26,000	275,600.00	0.58
9	00386	中国石油化工股份	58,000	245,340.00	0.51
10	01378	中国宏桥	31,500	184,590.00	0.39

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,986,729.78	108.54
	其中：政策性金融债	51,986,729.78	108.54
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）	3,028,913.16	6.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,015,642.94	114.87

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	190311	19 进出 11	200,000	20,753,386.30	43.33
2	210316	21 进出 16	100,000	10,521,438.36	21.97
3	092203005	22 进出口行二级资本债 01	100,000	10,318,479.45	21.54
4	190404	19 农发 04	100,000	10,189,352.46	21.27
5	111010	立昂转债	1,740	217,066.00	0.45

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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

中国建设银行股份有限公司因公司治理和内部控制制度与监管规定不符、个人经营贷款挪用至房地产市场、理财老产品规模在部分时点出现反弹等行为在本报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚。

中国进出口银行因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为等原因在本报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚。

中国农业银行因理财托管业务违反资产独立性原则要求等原因在本报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管

措施决定书外，其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,606.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	15,128.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	18,734.72

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111010	立昂转债	217,066.00	0.45
2	123142	申昊转债	120,838.56	0.25
3	118027	宏图转债	100,588.87	0.21
4	113660	寿22转债	97,007.22	0.20
5	113662	豪能转债	96,324.94	0.20
6	128122	兴森转债	94,277.15	0.20
7	123170	南电转债	93,942.80	0.20
8	113588	润达转债	93,328.66	0.19
9	118019	金盘转债	89,410.56	0.19
10	110080	东湖转债	86,950.59	0.18
11	128123	国光转债	78,131.96	0.16
12	113527	维格转债	76,552.48	0.16
13	113621	彤程转债	73,865.96	0.15
14	127065	瑞鹤转债	73,862.25	0.15
15	113594	淳中转债	71,938.70	0.15
16	127029	中钢转债	67,839.37	0.14
17	128132	交建转债	62,431.71	0.13
18	123090	三诺转债	61,150.41	0.13
19	110060	天路转债	60,891.06	0.13
20	113024	核建转债	60,505.70	0.13
21	127050	麒麟转债	57,333.87	0.12
22	123031	晶瑞转债	57,242.64	0.12

23	123163	金沃转债	56,816.87	0.12
24	113059	福莱转债	47,966.41	0.10
25	123071	天能转债	47,741.58	0.10
26	127007	湖广转债	45,812.60	0.10
27	111000	起帆转债	45,420.65	0.09
28	123107	温氏转债	43,958.61	0.09
29	110061	川投转债	38,478.60	0.08
30	127014	北方转债	35,365.11	0.07
31	110090	爱迪转债	34,868.69	0.07
32	128125	华阳转债	33,307.93	0.07
33	113657	再 22 转债	32,919.25	0.07
34	113546	迪贝转债	32,310.05	0.07
35	113524	奇精转债	31,111.27	0.06
36	113563	柳药转债	28,645.27	0.06
37	127058	科伦转债	28,345.81	0.06
38	110045	海澜转债	27,675.08	0.06
39	128143	锋龙转债	27,659.53	0.06
40	118017	深科转债	27,239.00	0.06

5.11.5 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康申润一年持有期混合 A	泰康申润一年持有期混合 C
报告期期初基金份额总额	42,164,438.50	8,237,648.74
报告期期间基金总申购份额	51,634.28	2,350.74
减：报告期期间基金总赎回份额	4,539,620.37	236,096.07
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	37,676,452.41	8,003,903.41

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20230531 - 20230630	9,554,706.16	-	-	9,554,706.16	20.92
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>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康申润一年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康申润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康申润一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康申润一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康申润一年持有期混合型证券投资基金产品资料概要》。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《证券时报》）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。

泰康基金管理有限公司

2023 年 7 月 20 日