

# 泰康宏泰回报混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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

送出日期：2024 年 8 月 29 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>49</b>
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	53
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	53

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 .....	53
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 .....	53
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
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	63
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
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
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
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	泰康宏泰回报混合型证券投资基金	
基金简称	泰康宏泰回报混合	
基金主代码	002767	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年6月8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	
报告期末基金份额总额	461,197,336.30份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰康宏泰回报混合 A	泰康宏泰回报混合 C
下属分级基金的交易代码	002767	018037
报告期末下属分级基金的份额总额	459,957,920.49份	1,239,415.81份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过合理配置大类资产和精选投资标的，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	<p>本基金将充分发挥管理人在大类资产配置上的投研优势，综合运用定量分析和定性分析手段，全面评估证券市场当期的投资环境并对可以预见的未来时期内各大类资产的风险收益状况进行分析与预测。在此基础上，制定本基金在权益类资产与固收类资产上的战略配置比例，并定期或不定期地进行调整。</p> <p>权益类投资方面，在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与权益类资产的投资，以增加基金收益。本基金在股票基本面研究的基础上，同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的上市公司股票进行投资。</p> <p>固定收益类投资方面，本基金通过分析宏观经济运行情况、判断经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。另外，本基金在分析各类债券资产的信用风险、流动性风险及其收益率水平的基础上，通过比较或合理预期各类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整优先配置的资产类别和配置比例。</p>
业绩比较基准	15%*沪深 300 指数收益率+80%*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		泰康基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	张姗
	联系电话	010-89620366	400-61-95555
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4001895522	400-61-95555
传真		010-89620100	0755-83195201
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		金志刚	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	泰康基金管理有限公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、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(2024年1月1日-2024年6月30日)		
	泰康宏泰回报混合 A	泰康宏泰回报混合 C	
本期已实现收益	-5,384,405.10	-10,745.29	
本期利润	19,511,964.14	28,906.46	
加权平均基金份额本期利润	0.0357	0.0277	
本期加权平均净值利润率	2.23%	1.73%	
本期基金份额净值增长率	2.24%	2.08%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)		
	期末可供分配利润	243,007,959.44	646,988.92
	期末可供分配基金份额利润	0.5283	0.5220
	期末基金资产净值	744,767,400.53	1,999,171.31
	期末基金份额净值	1.6192	1.6130
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)		
	基金份额累计净值增长率	61.92%	1.47%

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

泰康宏泰回报混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.41%	0.09%	0.19%	0.07%	-0.60%	0.02%
过去三个月	0.78%	0.14%	1.09%	0.10%	-0.31%	0.04%
过去六个月	2.24%	0.17%	3.21%	0.13%	-0.97%	0.04%
过去一年	2.44%	0.17%	3.23%	0.13%	-0.79%	0.04%
过去三年	3.51%	0.24%	6.14%	0.16%	-2.63%	0.08%
自基金合同生效起至今	61.92%	0.27%	34.28%	0.17%	27.64%	0.10%

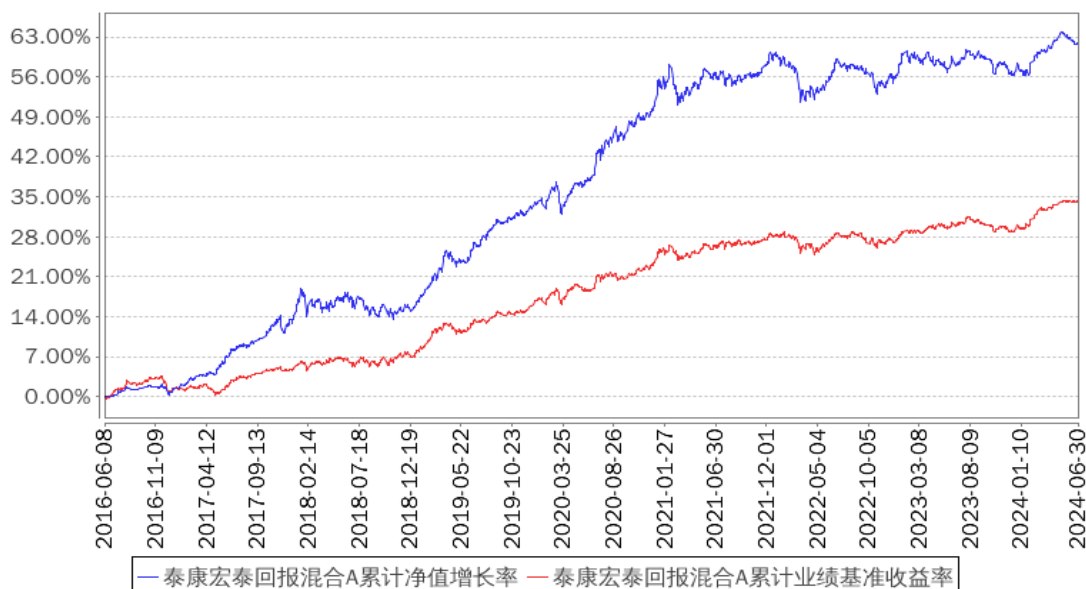
泰康宏泰回报混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.44%	0.09%	0.19%	0.07%	-0.63%	0.02%
过去三个月	0.70%	0.14%	1.09%	0.10%	-0.39%	0.04%
过去六个月	2.08%	0.17%	3.21%	0.13%	-1.13%	0.04%
过去一年	2.13%	0.17%	3.23%	0.13%	-1.10%	0.04%
自基金合同生效起至今	1.47%	0.18%	4.30%	0.13%	-2.83%	0.05%

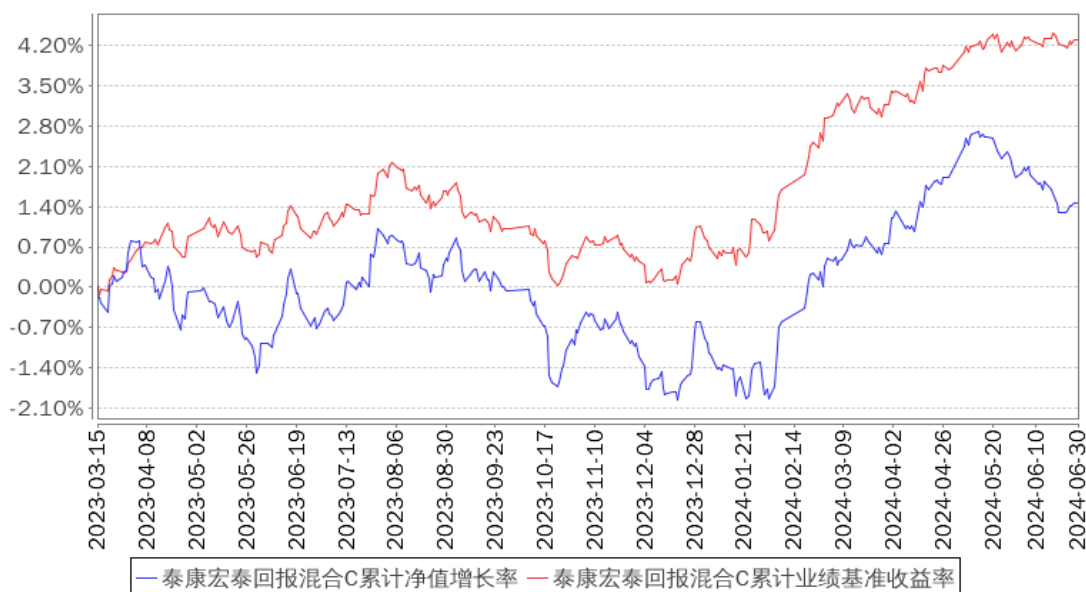


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰康宏泰回报混合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



泰康宏泰回报混合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 2016 年 06 月 08 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

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）前身为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）公募事业部，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。2021年9月1日，泰康资产获得证监会批准设立子公司泰康基金，2021年10月12日，泰康基金完成工商注册。2022年11月18日，泰康资产旗下公募基金产品的基金管理人变更为泰康基金。

泰康基金注册地为北京，注册资本为1.2亿元人民币。截至2024年6月30日，泰康基金共管理83只证券投资基金，已形成包括货币、债券、偏债混合、偏股混合、主动权益、沪港深系列、主动量化及被动指数、FOF基金等不同类型、不同风险收益特征的产品系列，并在养老目标基金、宽基及细分行业主题ETF、双碳、科技、大健康等方面均进行了战略布局，为广大投资者提供了丰富多元的投资选择。

#### 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		
桂跃强	本基金基金经理、权益投资部负责人	2016年6月8日	-	16年	桂跃强于2015年8月加入泰康公募，担任公募事业部权益投资负责人。现任泰康基金权益投资部负责人、权益基金经理。曾任石油化工科学研究院工程师，新华基金管理有限公司基金管理部副总监、基金经理等职务。2015年12月8日至2024年7月8日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6月8日至今担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2016年11月28日至2020年9月22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6月15日至今担任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017年6月20日至2020年7月2日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。2017年12月13日至2020年1月10日担任泰康景泰回报混合型证券投资基金基金经理。2018年1月19日至2020年1月10日担任泰康均衡

					<p>优选混合型证券投资基金基金经理。2018年5月30日至今担任泰康颐年混合型证券投资基金基金经理。2018年6月13日至2020年7月24日担任泰康颐享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。2020年5月20日至2023年2月7日担任泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020年8月14日至今担任泰康蓝筹优势一年持有期股票型证券投资基金基金经理。2020年12月22日至今担任泰康优势企业混合型证券投资基金基金经理。2021年12月14日至今担任泰康鼎泰一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
蒋利娟	本基金基金经理、固定收益投资部负责人	2016年6月8日	-	16年	<p>蒋利娟于2008年7月加入泰康资产，历任集中交易室交易员、固定收益部固定收益投资经理。2014年11月加入泰康公募，担任固定收益基金经理、公募事业部固定收益投资负责人。现任泰康基金固定收益投资部负责人、固定收益基金经理。2015年6月19日至今担任泰康薪意保货币市场基金基金经理。2015年9月23日至2020年1月6日担任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年12月8日至2016年12月27日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2月3日至今担任泰康稳健增利债券型证券投资基金基金经理。2016年6月8日至今担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017年1月22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6月15日至今担任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017年8月30日至2019年5月9日担任泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年9月8日至2020年3月26日担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。2018年5月30日至今担任泰康颐年混合型证券投资基金基金经理。2018年6月13日至2023年6月9日担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2018年8月24</p>

					日至 2020 年 1 月 14 日担任泰康弘实 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 12 月 25 日至 2021 年 1 月 11 日担任泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 20 日至今担任泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 7 日至今担任泰康合润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。2024 年 5 月 31 日至今担任泰康稳健双利债券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 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

上半年宏观经济呈现出结构分化、总量压力逐步凸显的特征。上半年 GDP 实现了 5.0% 增速，二季度 GDP 增速为 4.7%，边际上有所下滑，核心是消费在二季度表现不佳。居民部门的收入增速、消费倾向、因地产业形势变化的财富效应等在二季度都不太乐观。政策坚持了以中长期结构转型为主导的方向，制造业研发、生产、出口继续对经济形成托底。

今年上半年是债券市场的牛市，利率下行的趋势相对较为顺畅，期间数据的阶段性企稳、央行对长端利率的预期引导，引发了利率的阶段性小幅反弹，但总体长短端利率都处于下行通道。除了基本面的因素，资产荒的环境也是核心主导因素，配债资金持续大于债券供给，供需的失衡也是宏观储蓄进一步提升的结果。

权益市场方面，2024 年上半年整体偏弱震荡运行。从大盘指数整体表现上来看，上半年上证指数下跌 0.25%，沪深 300 上涨 0.89%，创业板指下跌 10.99%，恒生综合指数上涨 3.39%，恒生科技下跌 5.57%。申万一级行业表现来看，银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化等行业表现较好，综合、计算机、商贸零售、社会服务、传媒等行业下跌较多。

固收投资策略上，在利率债方面，根据市场形势调节仓位和久期，同时适当参与了利率债波段交易；在信用债方面，严格防范信用风险，积极规避尾部风险。

权益投资方面，上半年市场整体表现平淡，低估值、高股息、基本面展望相对稳定的红利类股票表现较好。本基金小幅调降了仓位，并对持仓结构进行了一些调整：主要增加了对经营稳健、分红率较高企业的持仓，更看重企业的经营质量、稳健性以及股息回报，通过分散持仓结构，降低组合的波动性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 份额净值为 1.6192 元，本报告期基金 A 份额净值增长率为 2.24%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.6130 元，本报告期基金 C 份额净值增长率为 2.08%；同期业绩比较基准增长率为 3.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计经济结构强分化的特征总体延续。政策思路预计继续统一在中国式现代化的框架下，粗放式的需求侧刺激较难出现，取而代之的是经济转型和高质量发展。信贷和社融在下半年或继续抛弃规模情节；财政政策力度在化债的主方针下，空间不会很大；货币政策有继续放松的空间，也需要平衡汇率等因素。下半年可能更多的是等待美国新一任总统上任的过渡期，为可能新的国际形势进行准备。

展望下半年，预计债券市场总体仍然处于偏有利的环境中，只是下行的斜率和幅度很难达到上半年的程度。基本面的方向较难发生较大改变，政策思路也不会有太大的变化，资产荒的环境持续。如果经济数据进一步下滑，或者汇率压制阶段性减轻，货币政策有进一步放松的可能，从而打开利率下行的空间。

固收方面，资产荒背景下，票息收益明显下降，投资策略上，在把握大趋势情况下，将重视利率债等品种的波段交易。

展望下半年，一方面，过去几十年经济全球化的趋势，正面临越来越大的挑战，贸易壁垒、贸易争端不断，地缘政治因素也成为关注重点；另一方面，A股、港股市场经过几年的调整，也越发呈现出投资价值。我们将重点关注调整充分，需求稳定，经营质量较高的品种。

#### 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，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF及多资产配置部）、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的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、北京证券交易所，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，并经托管人复核确认。

#### 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。

#### 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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：泰康宏泰回报混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	167,855.50	10,464,424.60
结算备付金		9,691,367.31	4,177,304.54
存出保证金		21,834.18	17,876.73
交易性金融资产	6.4.7.2	987,384,222.38	1,436,816,195.92
其中：股票投资		105,338,624.39	186,703,999.42
基金投资		-	-
债券投资		882,045,597.99	1,250,112,196.50
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	-	30,006,205.65
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		46,021.06	1,312,771.13
应收股利		-	-
应收申购款		17,193.94	35,069.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		997,328,494.37	1,482,829,847.72
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		247,132,124.46	398,058,919.06
应付清算款		47,055.12	1,321,623.46
应付赎回款		1,561,331.74	1,242,826.08



应付管理人报酬		747,557.69	1,099,385.19
应付托管费		124,592.94	183,230.88
应付销售服务费		489.92	382.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		748,520.89	782,602.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	200,249.77	139,166.94
负债合计		250,561,922.53	402,828,136.00
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	461,197,336.30	681,913,493.84
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	285,569,235.54	398,088,217.88
净资产合计		746,766,571.84	1,080,001,711.72
负债和净资产总计		997,328,494.37	1,482,829,847.72

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 461,197,336.30 份，其中泰康宏泰回报混合 A 基金份额总额 459,957,920.49 份，基金份额净值 1.6192 元；泰康宏泰回报混合 C 基金份额总额 1,239,415.81 份，基金份额净值 1.6130 元。

## 6.2 利润表

会计主体：泰康宏泰回报混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		28,768,427.82	46,287,350.18
1. 利息收入		27,649.20	115,351.14
其中：存款利息收入	6.4.7.13	25,625.15	115,351.14
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		2,024.05	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,799,672.31	48,364,108.95
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-17,071,382.09	9,466,304.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	18,504,100.68	34,503,556.60
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			

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	2,366,953.72	4,394,247.65
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	24,936,020.99	-2,331,642.14
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	5,085.32	139,532.23
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>9,227,557.22</b>	<b>19,582,972.94</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,246,938.45	10,715,873.25
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	874,489.71	1,785,978.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,484.57	226.44
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,924,950.64	6,829,502.76
其中：卖出回购金融资产支出		2,924,950.64	6,829,502.76
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		34,806.56	89,250.17
8. 其他费用	6.4.7.23	143,887.29	162,141.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>19,540,870.60</b>	<b>26,704,377.24</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>19,540,870.60</b>	<b>26,704,377.24</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>19,540,870.60</b>	<b>26,704,377.24</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：泰康宏泰回报混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	681,913,493.84	-	398,088,217.88	1,080,001,711.7

资产				2
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	681,913,493.84	-	398,088,217.88	1,080,001,711.7 2
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-333,235,139.88
(一)、综合收益总额	-	-	19,540,870.60	19,540,870.60
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-352,776,010.48
其中：1. 基金申购款	4,698,032.77	-	2,877,153.53	7,575,186.30
2. 基金赎回款	-	-	-	-360,351,196.78
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	461,197,336.30	-	285,569,235.54	746,766,571.84
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,356,807,054. 51	-	764,772,254.73	2,121,579,309.2 4
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,356,807,054.51	-	764,772,254.73	2,121,579,309.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	464,634,512.25	-	246,647,733.80	-711,282,246.05
(一)、综合收益总额	-	-	26,704,377.24	26,704,377.24
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	464,634,512.25	-	273,352,111.04	-737,986,623.29
其中：1. 基金申购款	10,110,595.48	-	5,974,801.89	16,085,397.37
2. 基金赎回款	474,745,107.73	-	279,326,912.93	-754,072,020.66
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	892,172,542.26	-	518,124,520.93	1,410,297,063.19

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：

金志刚

基金管理人负责人

金志刚

主管会计工作负责人

李俊佑

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰康宏泰回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]902号《关于准予泰康宏泰回报混合型证券投资基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康宏泰回报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602,359,807.54元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第670号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为602,430,818.84份基金份额,其中认购资金利息折合71,011.30份基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金招募说明书》,本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为A类和C类不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用而不计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者申购基金份额时不收取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《泰康宏泰回报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核准上市的股票、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、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、同业存单、通知存款和其他银行存款)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:本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的30%;持有的全部权证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,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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:15%×沪深300指数收益率+80%×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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《泰康宏泰回报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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产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

本基金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。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	167,855.50
等于：本金	167,778.27
加：应计利息	77.23
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	167,855.50

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	111,139,171.75	-	105,338,624.39	-5,800,547.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,320,260.71	147,355,117.73	-652,905.49
	银行间市场	712,453,312.25	9,476,380.26	12,760,787.75
	合计	858,141,074.76	11,796,640.97	882,045,597.99
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-



其他	-	-	-	-
合计	969,280,246.51	11,796,640.97	987,384,222.38	6,307,334.90

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 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

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 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

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	89,297.68
其中：交易所市场	60,303.13
银行间市场	28,994.55
应付利息	-
预提费用	110,940.02
合计	200,249.77

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 泰康宏泰回报混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	680,969,547.32	680,969,547.32
本期申购	4,229,078.89	4,229,078.89
本期赎回（以“-”号填列）	-225,240,705.72	-225,240,705.72
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	459,957,920.49	459,957,920.49

## 泰康宏泰回报混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	943,946.52	943,946.52
本期申购	468,953.88	468,953.88
本期赎回（以“-”号填列）	-173,484.59	-173,484.59
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	1,239,415.81	1,239,415.81

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

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

泰康宏泰回报混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	367,086,928.90	30,453,735.86	397,540,664.76
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	367,086,928.90	30,453,735.86	397,540,664.76
本期利润	-5,384,405.10	24,896,369.24	19,511,964.14
本期基金份额交易产生的变动数	-118,694,564.36	-13,548,584.50	-132,243,148.86
其中：基金申购款	2,241,634.78	345,011.73	2,586,646.51
基金赎回款	-120,936,199.14	-13,893,596.23	-134,829,795.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	243,007,959.44	41,801,520.60	284,809,480.04

泰康宏泰回报混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	505,115.76	42,437.36	547,553.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	505,115.76	42,437.36	547,553.12
本期利润	-10,745.29	39,651.75	28,906.46
本期基金份额交易产生的变动数	152,618.45	30,677.47	183,295.92
其中：基金申购款	242,669.63	47,837.39	290,507.02
基金赎回款	-90,051.18	-17,159.92	-107,211.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	646,988.92	112,766.58	759,755.50

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	2,689.47
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	22,788.72
其他	146.96
合计	25,625.15

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-17,071,382.09
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	-17,071,382.09

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	99,195,043.05
减：卖出股票成本总额	116,118,769.04
减：交易费用	147,656.10
买卖股票差价收入	-17,071,382.09

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	15,485,684.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,018,416.24
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	18,504,100.68

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	761,827,958.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	747,590,215.84
减：应计利息总额	11,199,879.41
减：交易费用	19,447.35
买卖债券差价收入	3,018,416.24

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,366,953.72
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	2,366,953.72

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	24,936,020.99
股票投资	21,236,311.03
债券投资	3,699,709.96
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	24,936,020.99

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	4,378.28
基金转换费收入	707.04
合计	5,085.32

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

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	42,267.68
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	23,347.27
债券帐户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	143,887.29

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 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

截至财务报表报出日，本基金并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

本报告期与基金管理人存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
泰康基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人控股股东
嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

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**

无。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,246,938.45	10,715,873.25
其中：应支付销售机构的客户维 护费	2,280,583.43	3,842,353.48
应支付基金管理人的净管理费	2,966,355.02	6,873,519.77

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	874,489.71	1,785,978.89

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 X 0.20% / 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 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康宏泰回报混合 A	泰康宏泰回报混合 C	合计
泰康基金管理有限公司	-	62.01	62.01
招商银行	-	1,530.15	1,530.15
合计	-	1,592.16	1,592.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康宏泰回报混合 A	泰康宏泰回报混合 C	合计
泰康基金管理有限公司	-	15.87	15.87
合计	-	15.87	15.87

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 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.30% / 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	-	-	-	-	1,240,300.00	108,885.91

## 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

无。

## 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

无。

## 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固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 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

份额单位：份

泰康宏泰回报混合 A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
泰康资产管理有限责任公司	-	-	41,147,866.76	6.0425

注：本报告期末，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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
招商银行	167,855.50	2,689.47	188,899.83	5,604.68

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末（2024 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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定期流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定期流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定期流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定期流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定期流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定期流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定期流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏	2024	6个月	新股	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-

	鼎达	年 3 月 13 日	月	锁定期流通受限						
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股锁定期流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁定期流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定期流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定期流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股锁定期流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-

601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股锁定期流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定期流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定期流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定期流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股锁定期流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定期流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股锁定期流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定期流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定期流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

				限						
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定期流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定期流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定期流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定期流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定期流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

注：1、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中需要限售的部分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。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，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。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

5、截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

6、根据骏鼎达2023年年度权益分派实施公告，以方案实施前的公司总股本40,000,000股为基数，向全体股东每10股派发现金红利7.00元（含税），每10股派送红股4股。除权除息日为

2024 年 5 月 22 日，本基金所持有的骏鼎达获得转增股 43 股。根据诺瓦星云 2023 年年度权益分派实施公告，以方案实施前的公司总股本 51,360,000 股为基数，向全体股东每股派发现金红利 97.00 元（含税），每 10 股派送红股 8 股。除权除息日为 2024 年 5 月 30 日，本基金所持有的诺瓦星云获得转增股 553。根据雪祺电气 2023 年年度权益分派实施公告，以方案实施前的公司总股本 136,760,000 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 3.50 元（含税），每 10 股派送红股 3 股。除权除息日为 2024 年 6 月 3 日，本基金所持有的雪祺电气获得转增股 40 股。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 229,632,124.46 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101901538	19 蒙高路 MTN003	2024 年 7 月 1 日	104.00	100,000	10,400,059.02
101901600	19 陕煤化 MTN006	2024 年 7 月 1 日	103.25	200,000	20,649,567.21
101901649	19 陕煤化 MTN007	2024 年 7 月 1 日	103.25	100,000	10,325,491.80
102001077	20 奉贤发展 MTN001	2024 年 7 月 1 日	101.26	100,000	10,125,846.58
102001252	20 燕子矶片 MTN002	2024 年 7 月 1 日	101.69	100,000	10,168,663.01
102100134	21 海宁城投 MTN002	2024 年 7 月 1 日	102.91	100,000	10,290,908.20
102381075	23 徐工租赁 MTN001	2024 年 7 月 1 日	101.02	30,000	3,030,614.30
212400004	24 光大银行小微债	2024 年 7 月 1 日	100.63	50,000	5,031,286.30
2128025	21 建设银行二级 01	2024 年 7 月 1 日	105.89	100,000	10,588,836.06
2128042	21 兴业银行二级 02	2024 年 7 月 1 日	105.66	500,000	52,831,426.23
2128051	21 工商银行二级 02	2024 年 7 月 1 日	105.16	200,000	21,032,740.98
2228041	22 农业银行	2024 年 7 月 1 日	103.88	200,000	20,775,123.29

	二级 01	日			
230014	23 付息国债 14	2024 年 7 月 1 日	103.05	200,000	20,610,613.70
230306	23 进出 06	2024 年 7 月 1 日	101.66	30,000	3,049,717.21
2320026	23 徽商银行	2024 年 7 月 1 日	103.88	100,000	10,387,732.24
232400014	24 民生银行 二级资本债 01	2024 年 7 月 1 日	100.85	70,000	7,059,164.39
2128025	21 建设银行 二级 01	2024 年 7 月 2 日	105.89	272,000	28,801,634.10
合计				2,452,000	255,159,424.62

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 17,500,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日(先后)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 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，制定了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风



险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	26,360,591.76	96,240,530.61
合计	26,360,591.76	96,240,530.61

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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	373,479,512.35	560,779,167.38
AAA 以下	244,343,040.33	384,937,664.33
未评级	108,219,948.42	139,462,069.01
合计	726,042,501.10	1,085,178,900.72

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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024 年 06 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(净资产)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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 2024 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 2024 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有货币资金、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	167,855.50	-	-	-	167,855.50
结算备付金	9,691,367.31	-	-	-	9,691,367.31
存出保证金	21,834.18	-	-	-	21,834.18
交易性金融资产	371,221,351.02	190,464,503.52	320,359,743.45	105,338,624.39	987,384,222.38
应收申购款	-	-	-	17,193.94	17,193.94

应收清算款	-	-	-	46,021.06	46,021.06
资产总计	381,102,408.01	190,464,503.52	320,359,743.45	105,401,839.39	997,328,494.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,561,331.74	1,561,331.74
应付管理人报酬	-	-	-	747,557.69	747,557.69
应付托管费	-	-	-	124,592.94	124,592.94
应付清算款	-	-	-	47,055.12	47,055.12
卖出回购金融资产款	247,132,124.46	-	-	-	247,132,124.46
应付销售服务费	-	-	-	489.92	489.92
应交税费	-	-	-	748,520.89	748,520.89
其他负债	-	-	-	200,249.77	200,249.77
负债总计	247,132,124.46	-	-	3,429,798.07	250,561,922.53
利率敏感度缺口	133,970,283.55	190,464,503.52	320,359,743.45	101,972,041.32	746,766,571.84
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,464,424.60	-	-	-	10,464,424.60
结算备付金	4,177,304.54	-	-	-	4,177,304.54
存出保证金	17,876.73	-	-	-	17,876.73
交易性金融资产	553,158,784.67	314,994,831.53	381,958,580.30	186,703,999.42	1,436,816,195.92
买入返售金融资产	30,006,205.65	-	-	-	30,006,205.65
应收申购款	-	-	-	35,069.15	35,069.15
应收清算款	-	-	-	1,312,771.13	1,312,771.13
资产总计	597,824,596.19	314,994,831.53	381,958,580.30	188,051,839.70	1,482,829,847.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,242,826.08	1,242,826.08
应付管理人报酬	-	-	-	1,099,385.19	1,099,385.19
应付托管费	-	-	-	183,230.88	183,230.88
应付清算款	-	-	-	1,321,623.46	1,321,623.46
卖出回购金融资产款	398,058,919.06	-	-	-	398,058,919.06
应付销售服务费	-	-	-	382.24	382.24
应交税费	-	-	-	782,602.15	782,602.15
其他负债	-	-	-	139,166.94	139,166.94
负债总计	398,058,919.06	-	-	4,769,216.94	402,828,136.00
利率敏感度缺口	199,765,677.13	314,994,831.53	381,958,580.30	183,282,622.76	1,080,001,711.72

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

	相关风险变量的变动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
分析	市场利率上调 0.25%	-4,085,837.37	-4,378,838.34
	市场利率下调 0.25%	4,149,783.39	4,417,325.82

#### 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。本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的 30%；持有的全部权证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，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。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 2024年6月30日		上年度末 2023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	105,338,624.39	14.11	186,703,999.42	17.29

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	105,338,624.39	14.11	186,703,999.42	17.29

#### 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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准中的权益指数上涨5%	3,502,014.02	9,269,210.61
	业绩比较基准中的权益指数下跌5%	-3,502,014.02	-9,269,210.61

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	147,321,094.60	278,751,037.28
第二层次	839,564,179.71	1,156,695,768.78

第三层次	498,948.07	1,369,389.86
合计	987,384,222.38	1,436,816,195.92

#### 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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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	105,338,624.39	10.56
	其中：股票	105,338,624.39	10.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	882,045,597.99	88.44
	其中：债券	882,045,597.99	88.44
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,859,222.81	0.99
8	其他各项资产	85,049.18	0.01
9	合计	997,328,494.37	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	7,179,066.00	0.96
C	制造业	70,944,850.57	9.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,073,104.00	2.02
E	建筑业	-	-
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	46,981.02	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,074,545.12	1.62
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	105,338,624.39	14.11

### 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	000333	美的集团	445,534	28,736,943.00	3.85
2	600809	山西汾酒	71,880	15,158,054.40	2.03
3	600900	长江电力	521,200	15,073,104.00	2.02
4	002311	海大集团	275,916	12,981,847.80	1.74
5	002027	分众传媒	1,992,100	12,072,126.00	1.62
6	601088	中国神华	161,800	7,179,066.00	0.96
7	000858	五粮液	33,339	4,268,725.56	0.57
8	300760	迈瑞医疗	13,047	3,795,502.77	0.51
9	600660	福耀玻璃	62,600	2,998,540.00	0.40
10	600031	三一重工	150,946	2,490,609.00	0.33
11	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
12	301526	国际复材	9,723	32,377.59	0.00
13	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
14	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
15	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
16	601096	宏盛华源	3,918	16,024.62	0.00
17	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
18	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
19	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
20	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
21	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
22	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
23	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
24	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
25	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
26	301413	安培龙	213	8,807.55	0.00
27	301459	丰茂股份	208	8,259.68	0.00
28	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00

29	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
30	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
31	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
32	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
33	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
34	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
35	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
36	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
37	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
38	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
39	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
40	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
41	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
42	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
43	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
44	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
45	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
46	603231	索宝蛋白	161	2,743.44	0.00
47	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
48	001239	永达股份	189	2,623.32	0.00
49	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00
50	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00

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

## 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	601088	中国神华	7,141,970.00	0.66
2	600660	福耀玻璃	2,885,359.00	0.27
3	600809	山西汾酒	1,497,074.00	0.14
4	601033	永兴股份	203,747.40	0.02
5	688584	上海合晶	196,212.94	0.02
6	301589	诺瓦星云	175,235.09	0.02
7	688709	成都华微	163,929.12	0.02
8	688692	达梦数据	151,745.20	0.01
9	301580	爱迪特	90,709.10	0.01
10	301565	中仑新材	84,383.64	0.01
11	301536	星宸科技	77,713.44	0.01
12	603341	龙旗科技	77,428.00	0.01
13	301587	中瑞股份	66,406.88	0.01
14	301538	骏鼎达	59,504.12	0.01

15	688691	灿芯股份	48,875.46	0.00
16	603325	博隆技术	47,823.60	0.00
17	301591	肯特股份	42,435.12	0.00
18	688695	中创股份	41,630.08	0.00
19	603381	永臻股份	41,516.30	0.00
20	001389	广合科技	38,677.17	0.00

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	600519	贵州茅台	42,619,424.12	3.95
2	000858	五粮液	20,446,990.00	1.89
3	000333	美的集团	10,878,191.00	1.01
4	002027	分众传媒	8,954,820.00	0.83
5	002410	广联达	4,883,367.31	0.45
6	600285	羚锐制药	3,528,032.00	0.33
7	600031	三一重工	2,311,624.00	0.21
8	002304	洋河股份	797,877.00	0.07
9	688692	达梦数据	392,389.96	0.04
10	301589	诺瓦星云	266,517.90	0.02
11	301565	中仑新材	266,412.72	0.02
12	601033	永兴股份	254,886.42	0.02
13	301536	星宸科技	197,047.00	0.02
14	688709	成都华微	196,802.06	0.02
15	301580	爱迪特	156,830.16	0.01
16	688584	上海合晶	154,659.76	0.01
17	301591	肯特股份	151,375.75	0.01
18	301392	汇成真空	145,038.60	0.01
19	603341	龙旗科技	141,182.80	0.01
20	301539	宏鑫科技	123,719.32	0.01

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	13,517,082.98
卖出股票收入（成交）总额	99,195,043.05

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，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	73,400,602.48	9.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	315,292,582.20	42.22
	其中：政策性金融债	45,724,551.96	6.12
4	企业债券	79,053,402.18	10.59
5	企业短期融资券	26,360,591.76	3.53
6	中期票据	334,939,650.40	44.85
7	可转债（可交换债）	42,481,418.28	5.69
8	同业存单	-	-
9	其他	10,517,350.69	1.41
10	合计	882,045,597.99	118.12

## 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	2128025	21 建设银行二级 01	540,000	57,179,714.75	7.66
2	2128042	21 兴业银行二级 02	500,000	52,831,426.23	7.07
3	230012	23 付息国债 12	450,000	46,709,302.99	6.25
4	2120047	21 宁波银行二级 01	400,000	41,421,429.04	5.55
5	230306	23 进出 06	350,000	35,580,034.15	4.76

## 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

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

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

宁波银行股份有限公司因消费者个人信息管理不到位、贷款“三查”不尽职等行为在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局宁波监管局的公开处罚；因违规置换已核销贷款在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局宁波监管局的公开处罚；因债券交易授权管理不到位在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局上海监管局的责令改正和公开处罚。

兴业银行股份有限公司因对外包催收机构管理不严在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局上海监管局的责令改正和公开处罚；因治理违规在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局福建监管局的公开处罚。

中国建设银行股份有限公司因单个网点在同一会计年度内与超过 3 家保险公司开展保险业务合作等行为在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚；因并表管理内部审计存在不足等原因在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚。

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。

### 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	21,834.18
2	应收清算款	46,021.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,193.94

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,049.18

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110084	贵燃转债	3,914,426.14	0.52
2	110085	通 22 转债	2,591,291.84	0.35
3	128121	宏川转债	2,357,325.50	0.32
4	123169	正海转债	2,351,561.88	0.31
5	118034	晶能转债	2,163,328.41	0.29
6	118014	高测转债	1,942,328.61	0.26
7	128141	旺能转债	1,903,395.25	0.25
8	113048	晶科转债	1,782,399.18	0.24
9	128081	海亮转债	1,659,054.23	0.22
10	118031	天 23 转债	1,613,754.43	0.22
11	113051	节能转债	1,349,478.51	0.18
12	113064	东材转债	1,193,081.42	0.16
13	113661	福 22 转债	1,097,586.85	0.15
14	113641	华友转债	1,089,755.73	0.15
15	123108	乐普转 2	1,041,208.38	0.14
16	113655	欧 22 转债	879,214.78	0.12
17	127076	中宠转 2	825,944.62	0.11
18	113632	鹤 21 转债	817,777.02	0.11
19	113053	隆 22 转债	801,792.81	0.11
20	113675	新 23 转债	777,910.71	0.10
21	123194	百洋转债	770,740.62	0.10
22	113045	环旭转债	652,151.99	0.09
23	127072	博实转债	617,027.85	0.08
24	127042	嘉美转债	609,818.24	0.08
25	123115	捷捷转债	565,859.00	0.08
26	113058	友发转债	524,766.00	0.07
27	113054	绿动转债	478,529.71	0.06
28	127030	盛虹转债	477,386.84	0.06
29	127038	国微转债	452,390.07	0.06
30	113052	兴业转债	384,172.73	0.05
31	113519	长久转债	378,689.92	0.05
32	127069	小熊转债	375,362.78	0.05
33	113658	密卫转债	372,786.39	0.05
34	128134	鸿路转债	359,826.54	0.05
35	127086	恒邦转债	350,206.37	0.05
36	113050	南银转债	318,546.69	0.04

37	110095	双良转债	282,777.33	0.04
38	128137	洁美转债	247,367.44	0.03
39	123121	帝尔转债	246,302.13	0.03
40	113616	韦尔转债	223,413.76	0.03
41	127031	洋丰转债	221,629.32	0.03
42	127040	国泰转债	203,395.78	0.03
43	123119	康泰转 2	180,194.53	0.02
44	113044	大秦转债	150,331.37	0.02
45	118025	奕瑞转债	129,741.80	0.02
46	123035	利德转债	118,453.56	0.02
47	111002	特纸转债	99,732.62	0.01
48	123150	九强转债	90,981.27	0.01
49	123120	隆华转债	74,588.71	0.01
50	113637	华翔转债	73,891.84	0.01
51	113644	艾迪转债	43,063.51	0.01
52	111014	李子转债	10,613.21	0.00

#### 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 (%)
泰康宏泰回报混合 A	13,166	34,935.28	16,271,612.73	3.54	443,686,307.76	96.46
泰康宏泰回报混合 C	36	34,428.22	229,108.73	18.49	1,010,307.08	81.51
合计	13,193	34,957.73	16,500,721.46	3.58	444,696,614.84	96.42

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	泰康宏泰回报混合 A	24,760.90	0.0054
	泰康宏泰回报混合 C	63.02	0.0051
	合计	24,823.92	0.0054

### 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	泰康宏泰回报混合 A	0
	泰康宏泰回报混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康宏泰回报混合 A	0
	泰康宏泰回报混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康宏泰回报混合 A	泰康宏泰回报混合 C
基金合同生效日 (2016 年 6 月 8 日) 基金份额总额	602,430,818.84	-
本报告期期初基金 份额总额	680,969,547.32	943,946.52
本报告期基金总申 购份额	4,229,078.89	468,953.88
减：本报告期基金 总赎回份额	225,240,705.72	173,484.59
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	459,957,920.49	1,239,415.81

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基金份额持有人大会。

### 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

本基金管理人于 2024 年 1 月 20 日发布公告，陈奕伦先生自 2024 年 1 月 18 日起担任公司董事长，段国圣先生自 2024 年 1 月 18 日起不再担任公司董事长。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 10.6.2 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 (%)	
东北证券	2	32,191,716.32	29.08	26,360.31	28.98	-
国海证券	2	22,287,723.96	20.13	18,402.53	20.23	-
国盛证券	2	22,155,315.08	20.01	18,116.86	19.92	-

国投证券	2	19,019,768.88	17.18	15,655.58	17.21	-
信达证券	2	13,472,299.87	12.17	11,120.95	12.23	-
财通证券	2	1,050,955.19	0.95	859.03	0.94	-
华鑫证券	2	266,691.69	0.24	218.92	0.24	-
国金证券	2	170,160.91	0.15	139.65	0.15	-
开源证券	2	104,814.15	0.09	86.38	0.09	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

证券						
中信证券	3	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

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

## 2、交易单元的选择标准和程序

交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

（一）合规风控能力较强，经营行为规范，近一年内无重大违规行为及风险事件，未受监管机构重大处罚；

（二）财务状况和经营状况良好；

（三）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；

（四）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；

（五）能及时提供准确的信息资讯服务；

（六）满足基金运作的保密要求；

（七）有较强的交易能力；

（八）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、本报告期内本基金减少租用 8 个交易单元，国海证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，方正证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中金公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信建投证券上海、深圳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 (%)
东北证券	49,041,378.69	18.80	69,450,000.00	3.42	-	-
国海证券	21,598,543.24	8.28	58,850,000.00	2.90	-	-

国盛证 券	21,624,402 .08	8.29	78,780,000.0 0	3.88	-	-
国投证 券	15,778,686 .87	6.05	166,870,000. 00	8.21	-	-
信达证 券	41,309,418 .59	15.83	1,001,140,00 0.00	49.25	-	-
财通证 券	21,363,335 .40	8.19	587,600,000. 00	28.91	-	-
华鑫证 券	1,789,354. 77	0.69	-	-	-	-
国金证 券	12,646,844 .68	4.85	1,100,000.00	0.05	-	-
开源证 券	16,496,971 .65	6.32	69,000,000.0 0	3.39	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-

华福证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
汇丰前 海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	59,240,370 .00	22.71	-	-	-	-
中邮证 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	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《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	2024年01月17日
2	泰康宏泰回报混合型证券投资基金2023年第四季度报告	《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	2024年01月19日

3	泰康基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《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	2024 年 01 月 20 日
4	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增深圳前海微众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	《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	2024 年 03 月 08 日
5	泰康基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金在深圳前海微众银行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	《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	2024 年 03 月 25 日
6	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增上海大智慧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	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 03 月 28 日
7	泰康宏泰回报混合型证券投资基金 2023 年年度报告	《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	2024 年 03 月 29 日
8	泰康宏泰回报混合型证券投资基金 2024 年第一季度报告	《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	2024 年 04 月 19 日
9	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中泰证券股份有限公司转换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	2024 年 05 月 23 日
10	泰康宏泰回报混合型证券投资基金（泰康宏泰回报混合 C 份额）基金产品资料概要更新	《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	2024 年 06 月 26 日
11	泰康宏泰回报混合型证券投资基金（泰康宏泰回报混合 A 份额）基金产品资料概要更新	《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	2024 年 06 月 26 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宏泰回报混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康宏泰回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康宏泰回报混合型证券投资基金托管协议》。
- (五) 《泰康宏泰回报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（《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

2024 年 8 月 29 日