

泰康北交所精选两年定期开放混合型发起
式证券投资基金
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

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 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 |
| § 4 管理人报告 | 10 |
| 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 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 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 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 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 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 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 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 净资产变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| § 7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 43 |
| 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 | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |

| | | |
|-------------|-----------------------------------|-----------|
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策 | 48 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 48 |
| 7.12 | 投资组合报告附注 | 48 |
| § 8 | 基金份额持有人信息 | 50 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 50 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 50 |
| 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 | 50 |
| 8.4 | 发起式基金发起资金持有份额情况 | 51 |
| § 9 | 开放式基金份额变动 | 52 |
| § 10 | 重大事件揭示 | 53 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 53 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 53 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 53 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 57 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 59 |
| 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 | 59 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 59 |
| § 12 | 备查文件目录 | 60 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 60 |
| 12.2 | 存放地点 | 60 |
| 12.3 | 查阅方式 | 60 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------------|-------------------|
| 基金名称 | 泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 泰康北交所精选两年定开混合发起 | |
| 基金主代码 | 016325 | |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2023 年 4 月 7 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 | 28,104,811.44 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 泰康北交所精选两年定开混合发起 A | 泰康北交所精选两年定开混合发起 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 016325 | 016326 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 27,161,047.90 份 | 943,763.54 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的原则下，通过合理配置大类资产和精选北交所上市股票，追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金将利用基金管理人多年来在宏观经济分析上的丰富经验和积累，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。</p> <p>本基金主要投资北京证券交易所发行、上市的企业。本基金将重点关注具有较高流动性的优质北京证券交易所上市公司，采用定性和定量分析的方法，结合所投资行业创新型企业的特征，分别从内生增长、商业模式、竞争优势等方面进行深入分析，评估公司的行业特征、经营状况、财务数据、业绩驱动因素等，从中选择具有核心竞争优势和长期持续增长模式的公司。同时，结合流动性风险管理的需要审慎决定北交所单一个股在基金组合中的比例；在构建投资组合时，充分考虑不同行业企业驱动力的不同，合理分配不同行业股票的资产占比。</p> <p>考虑到多数北交所上市公司尚处于快速发展阶段，本基金将以发展的眼光考察北交所上市公司的表现，通过财务分析、实地调研等方式，重点考察公司的核心竞争力、产品特色与优势、产业链地位、管理层水平、盈利和现金流能力、应变能力、可持续发展能力等方面，挑选出潜质优良的投资标的。同时，本基金还将密</p> |

| | |
|--------|---|
| | 切跟踪上述指标的变化情况，整体考量组合的投资并进行动态调整。在定量分析方面，本基金将从成长性、价值性以及估值水平三个方面进行考量。本基金也将关注各个市场优质中小企业的投资机会，在深入研究的基础上，优选具备投资价值的个股纳入投资组合。此外，本基金将积极关注港股通、战略配售策略、转融通策略等投资机会。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、信用债等固定收益证券以及可转换债券/可交换债券等的投资。债券投资策略包括久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略、信用策略、个券精选策略等。在严格控制风险的前提下，通过配置不同类别和期限的债券品种，提高基金非股票资产的收益率。 |
| 业绩比较基准 | 中证 1000 指数收益率*70%+恒生指数收益率*5%+中债新综合全价（总值）指数收益率*25% |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>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。</p> |

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 | 《中国证券报》 |
| 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) | |
|---------------|---------------------------|-------------------|
| | 泰康北交所精选两年定开混合发起 A | 泰康北交所精选两年定开混合发起 C |
| 本期已实现收益 | 967,856.98 | 30,415.43 |
| 本期利润 | -6,613,965.10 | -231,845.40 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2435 | -0.2457 |
| 本期加权平均净值利润率 | -18.49% | -18.74% |
| 本期基金份额净值增长率 | -16.54% | -16.75% |
| 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 | 6,201,544.00 | 208,371.33 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2283 | 0.2208 |
| 期末基金资产净值 | 33,362,591.90 | 1,152,134.87 |
| 期末基金份额净值 | 1.2283 | 1.2208 |
| 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 | 22.83% | 22.08% |

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

泰康北交所精选两年定开混合发起 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 | -3.62% | 0.73% | -5.98% | 0.99% | 2.36% | -0.26% |
| 过去三个月 | -7.18% | 0.89% | -6.41% | 1.06% | -0.77% | -0.17% |
| 过去六个月 | -16.54% | 1.38% | -10.96% | 1.41% | -5.58% | -0.03% |
| 过去一年 | 7.87% | 1.51% | -17.95% | 1.11% | 25.82% | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.83% | 1.40% | -21.16% | 1.04% | 43.99% | 0.36% |

泰康北交所精选两年定开混合发起 C

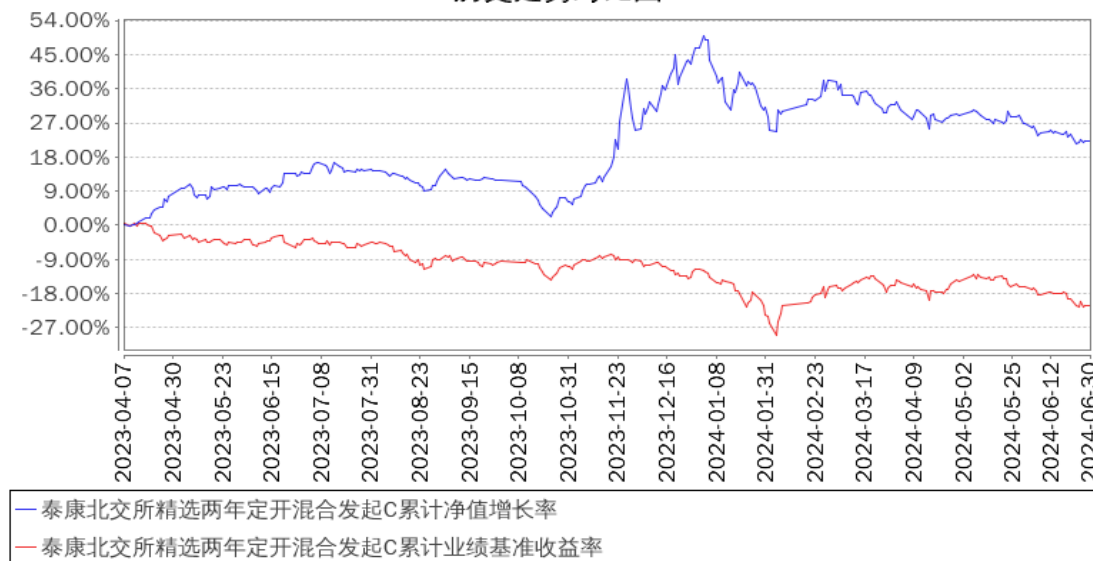
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -3.65% | 0.73% | -5.98% | 0.99% | 2.33% | -0.26% |
| 过去三个月 | -7.30% | 0.89% | -6.41% | 1.06% | -0.89% | -0.17% |
| 过去六个月 | -16.75% | 1.38% | -10.96% | 1.41% | -5.79% | -0.03% |
| 过去一年 | 7.33% | 1.51% | -17.95% | 1.11% | 25.28% | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.08% | 1.40% | -21.16% | 1.04% | 43.24% | 0.36% |

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

泰康北交所精选两年定开混合发起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



泰康北交所精选两年定开混合发起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 2023 年 04 月 07 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 | | |
| 陆建巍 | 本基金基金经理、权益研究部负责人 | 2023年4月7日 | - | 15年 | 陆建巍于2017年7月加入泰康公募，现任泰康基金权益研究部负责人、股票基金经理。曾任中信证券股份有限公司研究员、瑞银证券股份有限公司研究员、国泰君安证券股份有限公司首席分析师、广发基金管理有限公司研究部研究员等职务。2021年12月13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。2023年4月7日至今担任泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2023年6月2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。2024年1月12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。 |

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。

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。

权益投资方面，市场风险偏好下降压制了包括北交所公司在内的微盘股的估值水平，宏观经济上行方向不明，小微企业业绩压力更大，从分子和分母端压制了北交所行情，上半年北交所跌幅较大。本基金年初开始就对北交所持仓进行了减仓，并基于公司经营的变化，大部分仓位配置在低估值的品种，部分仓位配置于 AI 和机器人相关标的，保持一定的弹性。

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 1.2283 元，本报告期基金 A 份额净值增长率为-16.54%；

截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.2208 元,本报告期基金 C 份额净值增长率为-16.75%;同期业绩比较基准增长率为-10.96%。

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,市场仍要面对,国内宏观经济的修复速度仍旧具备的不确定性,美国大选带来的关税政策的不确定性,联储降息节奏的不确定性等因素带来的较大波动,寻找确定性仍旧是市场的主线。展望北交所,目前北证指数已经到了历史较低水平,部分北交所有增长的公司,估值远低于主板,北交所存在着错杀的机会。本基金下半年仍旧主要投资于低估值股票,把握业绩增长和估值修复的机会。

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

本基金为发起式基金且截至本报告期末,合同生效不满三年,不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的披露规定。

§ 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：泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金

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 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 13,916,658.90 | 15,995,215.24 |
| 结算备付金 | | 3,874.17 | 10,543.35 |
| 存出保证金 | | 15,296.93 | 19,673.56 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 20,666,223.30 | 25,548,432.55 |
| 其中：股票投资 | | 20,666,223.30 | 25,548,432.55 |
| 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 | - | - |
| 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 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 34,602,053.30 | 41,573,864.70 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 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 | | - | 132,723.00 |
| 应付赎回款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|---------------|---------------|
| 应付管理人报酬 | | 34,528.50 | 38,981.31 |
| 应付托管费 | | 5,754.75 | 6,496.89 |
| 应付销售服务费 | | 480.34 | 543.59 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 46,562.94 | 34,582.64 |
| 负债合计 | | 87,326.53 | 213,327.43 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 28,104,811.44 | 28,104,811.44 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 6,409,915.33 | 13,255,725.83 |
| 净资产合计 | | 34,514,726.77 | 41,360,537.27 |
| 负债和净资产总计 | | 34,602,053.30 | 41,573,864.70 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 28,104,811.44 份，其中泰康北交所精选两年定开混合发起 A 基金份额总额 27,161,047.90 份，基金份额净值 1.2283 元；泰康北交所精选两年定开混合发起 C 基金份额总额 943,763.54 份，基金份额净值 1.2208 元。

6.2 利润表

会计主体：泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金

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 4 月 7 日（基金 合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|--|
| 一、营业总收入 | | -6,539,736.09 | 4,028,457.00 |
| 1. 利息收入 | | 25,383.57 | 15,558.12 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 25,383.57 | 15,558.12 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以 “-”填列） | | 1,278,963.25 | 2,070,498.99 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 885,341.75 | 1,931,773.31 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 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 | 393,621.50 | 138,725.68 |
| 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 | -7,844,082.91 | 1,942,399.89 |
| 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 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 306,074.41 | 131,172.20 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 220,656.60 | 104,855.36 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 36,776.07 | 17,475.89 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 3,072.89 | 1,173.04 |
| 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 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 45,568.85 | 7,667.91 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -6,845,810.50 | 3,897,284.80 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -6,845,810.50 | 3,897,284.80 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -6,845,810.50 | 3,897,284.80 |

注：本基金合同生效日为 2023 年 4 月 7 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2023 年 4 月 7 日至 2023 年 06 月 30 日止期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金

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、上期期末净资产 | 28,104,811.44 | - | 13,255,725.83 | 41,360,537.27 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 28,104,811.44 | - | 13,255,725.83 | 41,360,537.27 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | - | - | -6,845,810.50 | -6,845,810.50 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -6,845,810.50 | -6,845,810.50 |
| (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) | - | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - | - |
| (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 | 28,104,811.44 | - | 6,409,915.33 | 34,514,726.77 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023 年 4 月 7 日(基金合同生效日)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 | - | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|---------------|---|--------------|---------------|
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 28,104,811.44 | - | - | 28,104,811.44 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | - | - | 3,897,284.80 | 3,897,284.80 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 3,897,284.80 | 3,897,284.80 |
| (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) | - | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - | - |
| (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 | 28,104,811.44 | - | 3,897,284.80 | 32,002,096.24 |

注：本基金合同生效日为 2023 年 4 月 7 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2023 年 4 月 7 日至 2023 年 06 月 30 日止期间。

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

泰康北交所精选两年定期开放混合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〔2022〕1504号《关于准予泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》及〔2022〕2707号《关于准予泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金变更注册的批复》核准，由泰康基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 28,099,957.28 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 2300734 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 28,104,811.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,854.16 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（以下简称“泰康基金”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

根据经中国证监会备案的《泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和《泰康北交所精选两年定期开放混合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、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。计算公式为计算日某类基金份额净值 = 计算日该类基金份额的基金资产净值 / 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《泰康北交所精选两年定期开放混合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，包括国内依法发行上市的股票（含北京证券交易所及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券资产（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持债券、政府支持机构债券、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（包括协议存款、定期存款和其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货、信用衍生品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。其中，股票投资部分可采取战略配售方式进行投资，除战略配售方式以外，本基金也可以通过中国证监会允许的其他方式进行股票投资。本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。在封闭期内，本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：封闭期内，本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%-100%，其中投资于北交所股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 20%；每个封闭期结束前的两个月至开放期结束后两个月内不受上述比例限制。开放期内，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%；封闭期内不受前述 5%限制，但封闭期内每个交易日日终，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*70%+恒生指数收益率*5%+中债新综合全价（总值）指数收益率*25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（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》、《泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式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

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》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 2024 年 6 月 30 日的财务状况、自 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。

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《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《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《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》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《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》、财税 [2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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，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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券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。

(b) 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。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

(c)对基金从上市公司、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，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。

(d)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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e)对基金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 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 | 13,916,658.90 |
| 等于：本金 | 13,915,307.13 |
| 加：应计利息 | 1,351.77 |
| 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 | 13,916,658.90 |

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 | 21,860,959.68 | - | 20,666,223.30 | -1,194,736.38 |
| 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 | 21,860,959.68 | - | 20,666,223.30 | -1,194,736.38 |

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 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 3,798.40 |
| 其中：交易所市场 | 3,798.40 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 42,764.54 |
| 合计 | 46,562.94 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰康北交所精选两年定开混合发起 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 | 27,161,047.90 | 27,161,047.90 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 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 | 27,161,047.90 | 27,161,047.90 |
|-----|---------------|---------------|

泰康北交所精选两年定开混合发起 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 | 943,763.54 | 943,763.54 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 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 | 943,763.54 | 943,763.54 |

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

泰康北交所精选两年定开混合发起 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 6,388,824.30 | 6,426,684.80 | 12,815,509.10 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 6,388,824.30 | 6,426,684.80 | 12,815,509.10 |
| 本期利润 | 967,856.98 | -7,581,822.08 | -6,613,965.10 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 7,356,681.28 | -1,155,137.28 | 6,201,544.00 |

泰康北交所精选两年定开混合发起 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------|------------|-------------|-------------|
| 上年度末 | 217,555.00 | 222,661.73 | 440,216.73 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 217,555.00 | 222,661.73 | 440,216.73 |
| 本期利润 | 30,415.43 | -262,260.83 | -231,845.40 |
| 本期基金份额交易产 | - | - | - |

| | | | |
|----------|------------|------------|------------|
| 生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 247,970.43 | -39,599.10 | 208,371.33 |

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 | 25,049.71 |
| 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 | 178.91 |
| 其他 | 154.95 |
| 合计 | 25,383.57 |

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 | 885,341.75 |
| 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 | 885,341.75 |

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 | 10,519,665.02 |
| 减：卖出股票成本总额 | 9,608,812.35 |
| 减：交易费用 | 25,510.92 |
| 买卖股票差价收入 | 885,341.75 |

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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 | 393,621.50 |
| 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 | 393,621.50 |

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 | -7,844,082.91 |
| 股票投资 | -7,844,082.91 |
| 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 | -7,844,082.91 |

6.4.7.21 其他收入

无。

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 | 17,901.52 |
| 信息披露费 | 24,863.02 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 2,804.31 |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 45,568.85 |
|----|-----------|

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

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4月7日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 220,656.60 | 104,855.36 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 7,939.63 | 3,208.74 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 212,716.97 | 101,646.62 |

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值乘以约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{管理费率} / \text{当年天数}$$

2023年8月21日前，本基金管理费率为1.50%。本基金管理人自2023年8月21日起对本基金实施调整后的基金管理费率，调整后的基金管理费率为1.20%。

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4月7日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
|----------------|----------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 36,776.07 | 17,475.89 |

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值乘以约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{托管费率} / \text{当年天数}$$

2023年8月21日前，本基金托管费率为0.25%。本基金管理人自2023年8月21日起对本基金实施调整后的基金管理费率，调整后的基金管理费率为0.20%。

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 | | |
| | 泰康北交所精选两年 | 泰康北交所精选两年 | 合计 |
| | | | |

| | 定开混合发起 A | 定开混合发起 C | |
|----------------|---|-------------------|----------|
| 泰康基金管理有限公司 | - | 2,275.66 | 2,275.66 |
| 合计 | - | 2,275.66 | 2,275.66 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2023 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰康北交所精选两年定开混合发起 A | 泰康北交所精选两年定开混合发起 C | 合计 |
| 泰康基金管理有限公司 | - | 868.60 | 868.60 |
| 合计 | - | 868.60 | 868.60 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$C \text{ 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类份额基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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

无。

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 2023 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日，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

泰康北交所精选两年定开混合发起 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 | 9,900,445.54 | 36.4509 | 9,900,445.54 | 36.4509 |
|--------------|--------------|---------|--------------|---------|

份额单位：份

泰康北交所精选两年定开混合发起 C

| 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 | 100,004.50 | 10.5964 | 100,004.50 | 10.5964 |

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4月7日（基金合同生效日）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 | 13,916,658.90 | 25,049.71 | 18,298,388.56 | 15,399.51 |

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

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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 | 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 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 | 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 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于约定开放日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于开放期内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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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》且于基金开放期内按照《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时间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%。于开放期内，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。在本基金开放日，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%。

于开放期内，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货币资金、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 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 | 13,916,658.90 | - | - | - | 13,916,658.90 |
| 结算备付金 | 3,874.17 | - | - | - | 3,874.17 |
| 存出保证金 | 15,296.93 | - | - | - | 15,296.93 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 20,666,223.30 | 20,666,223.30 |
| 资产总计 | 13,935,830.00 | - | - | 20,666,223.30 | 34,602,053.30 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 34,528.50 | 34,528.50 |
| 应付托管费 | - | - | - | 5,754.75 | 5,754.75 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 480.34 | 480.34 |
| 其他负债 | - | - | - | 46,562.94 | 46,562.94 |
| 负债总计 | - | - | - | 87,326.53 | 87,326.53 |
| 利率敏感度缺口 | 13,935,830.00 | - | - | 20,578,896.77 | 34,514,726.77 |
| 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 | 15,995,215.24 | - | - | - | 15,995,215.24 |
| 结算备付金 | 10,543.35 | - | - | - | 10,543.35 |
| 存出保证金 | 19,673.56 | - | - | - | 19,673.56 |

| | | | | | |
|---------|---------------|---|---|---------------|---------------|
| 交易性金融资产 | - | - | - | 25,548,432.55 | 25,548,432.55 |
| 资产总计 | 16,025,432.15 | - | - | 25,548,432.55 | 41,573,864.70 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 38,981.31 | 38,981.31 |
| 应付托管费 | - | - | - | 6,496.89 | 6,496.89 |
| 应付清算款 | - | - | - | 132,723.00 | 132,723.00 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 543.59 | 543.59 |
| 其他负债 | - | - | - | 34,582.64 | 34,582.64 |
| 负债总计 | - | - | - | 213,327.43 | 213,327.43 |
| 利率敏感度缺口 | 16,025,432.15 | - | - | 25,335,105.12 | 41,360,537.27 |

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 | | |
| 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） |
| | 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合比例为：封闭期内，本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%—100%，其中投资于北交所股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 20%；每个封闭期结束前的两个月至开放期结束后两个月内不受上述比例限制。开放期内，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%；封闭期内不受前述 5%限制，但封闭期内每个交易日日终，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；前述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 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 | 20,666,223.30 | 59.88 | 25,548,432.55 | 61.77 |
| 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 | 20,666,223.30 | 59.88 | 25,548,432.55 | 61.77 |

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% | 731,527.45 | - |

| | | | |
|--|-----------------------|-------------|---|
| | 业绩比较基准中的 权益指数下跌 5% | -731,527.45 | - |
|--|-----------------------|-------------|---|

注：于 2023 年 12 月 31 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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 20,666,223.30 | 25,543,762.55 |
| 第二层次 | - | 4,670.00 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 20,666,223.30 | 25,548,432.55 |

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。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

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 | 20,666,223.30 | 59.73 |
| | 其中：股票 | 20,666,223.30 | 59.73 |
| 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 | 13,920,533.07 | 40.23 |
| 8 | 其他各项资产 | 15,296.93 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 34,602,053.30 | 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 | 887,377.00 | 2.57 |
| C | 制造业 | 16,497,806.28 | 47.80 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,536.00 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 555,101.00 | 1.61 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 737,724.60 | 2.14 |
| J | 金融业 | 733,838.00 | 2.13 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 665,543.48 | 1.93 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 456,370.94 | 1.32 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| 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 | 127,926.00 | 0.37 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 20,666,223.30 | 59.88 |

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 | 430418 | 苏轴股份 | 127,499 | 1,690,636.74 | 4.90 |
| 2 | 833394 | 民士达 | 95,130 | 1,331,820.00 | 3.86 |
| 3 | 832471 | 美邦科技 | 96,013 | 866,037.26 | 2.51 |
| 4 | 430510 | 丰光精密 | 56,654 | 862,840.42 | 2.50 |
| 5 | 830839 | 万通液压 | 85,288 | 837,528.16 | 2.43 |
| 6 | 835179 | 凯德石英 | 49,010 | 803,764.00 | 2.33 |
| 7 | 834033 | 康普化学 | 47,270 | 739,775.50 | 2.14 |
| 8 | 839493 | 并行科技 | 17,590 | 737,724.60 | 2.14 |
| 9 | 832978 | 开特股份 | 71,987 | 684,596.37 | 1.98 |
| 10 | 837242 | 建邦科技 | 53,116 | 665,543.48 | 1.93 |
| 11 | 835174 | 五新隧装 | 36,753 | 634,724.31 | 1.84 |
| 12 | 833075 | 柏星龙 | 56,104 | 607,045.28 | 1.76 |
| 13 | 834058 | 华洋赛车 | 36,061 | 603,300.53 | 1.75 |
| 14 | 836239 | 长虹能源 | 35,834 | 599,144.48 | 1.74 |
| 15 | 872808 | 曙光数创 | 15,365 | 593,549.95 | 1.72 |
| 16 | 832469 | 富恒新材 | 61,717 | 501,759.21 | 1.45 |
| 17 | 838971 | 天马新材 | 50,533 | 469,956.90 | 1.36 |
| 18 | 836208 | 青矩技术 | 13,771 | 456,370.94 | 1.32 |
| 19 | 834062 | 科润智控 | 81,020 | 429,406.00 | 1.24 |
| 20 | 430139 | 华岭股份 | 45,390 | 423,942.60 | 1.23 |
| 21 | 835640 | 富士达 | 30,604 | 407,339.24 | 1.18 |
| 22 | 835438 | 戈碧迦 | 30,170 | 392,210.00 | 1.14 |
| 23 | 832419 | 路斯股份 | 49,756 | 373,170.00 | 1.08 |
| 24 | 831152 | 昆工科技 | 32,290 | 313,213.00 | 0.91 |
| 25 | 601857 | 中国石油 | 27,300 | 281,736.00 | 0.82 |
| 26 | 837663 | 明阳科技 | 27,671 | 267,025.15 | 0.77 |
| 27 | 601398 | 工商银行 | 45,300 | 258,210.00 | 0.75 |
| 28 | 871694 | 中裕科技 | 23,208 | 252,967.20 | 0.73 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 29 | 601000 | 唐山港 | 46,300 | 217,610.00 | 0.63 |
| 30 | 600282 | 南钢股份 | 43,500 | 216,630.00 | 0.63 |
| 31 | 600350 | 山东高速 | 24,300 | 215,055.00 | 0.62 |
| 32 | 600398 | 海澜之家 | 21,600 | 199,584.00 | 0.58 |
| 33 | 000157 | 中联重科 | 25,700 | 197,376.00 | 0.57 |
| 34 | 600066 | 宇通客车 | 7,300 | 188,340.00 | 0.55 |
| 35 | 600177 | 雅戈尔 | 24,500 | 174,440.00 | 0.51 |
| 36 | 600901 | 江苏金租 | 33,000 | 166,650.00 | 0.48 |
| 37 | 832982 | 锦波生物 | 1,114 | 166,420.46 | 0.48 |
| 38 | 833429 | 康比特 | 16,348 | 163,643.48 | 0.47 |
| 39 | 002032 | 苏泊尔 | 3,100 | 155,310.00 | 0.45 |
| 40 | 000895 | 双汇发展 | 6,300 | 149,751.00 | 0.43 |
| 41 | 000983 | 山西焦煤 | 13,400 | 138,154.00 | 0.40 |
| 42 | 601098 | 中南传媒 | 10,300 | 127,926.00 | 0.37 |
| 43 | 601006 | 大秦铁路 | 17,100 | 122,436.00 | 0.35 |
| 44 | 601088 | 中国神华 | 2,700 | 119,799.00 | 0.35 |
| 45 | 002601 | 龙佰集团 | 5,800 | 107,706.00 | 0.31 |
| 46 | 600188 | 兖矿能源 | 4,700 | 106,831.00 | 0.31 |
| 47 | 000937 | 冀中能源 | 11,700 | 78,390.00 | 0.23 |
| 48 | 600028 | 中国石化 | 10,300 | 65,096.00 | 0.19 |
| 49 | 601988 | 中国银行 | 12,800 | 59,136.00 | 0.17 |
| 50 | 601009 | 南京银行 | 5,200 | 54,028.00 | 0.16 |
| 51 | 601838 | 成都银行 | 3,400 | 51,646.00 | 0.15 |
| 52 | 601077 | 渝农商行 | 10,200 | 51,204.00 | 0.15 |
| 53 | 601699 | 潞安环能 | 2,700 | 48,951.00 | 0.14 |
| 54 | 601825 | 沪农商行 | 7,200 | 48,384.00 | 0.14 |
| 55 | 600919 | 江苏银行 | 6,000 | 44,580.00 | 0.13 |
| 56 | 832651 | 天罡股份 | 2,199 | 30,698.04 | 0.09 |
| 57 | 870656 | 海昇药业 | 1,500 | 20,085.00 | 0.06 |
| 58 | 600938 | 中国海油 | 600 | 19,800.00 | 0.06 |
| 59 | 600582 | 天地科技 | 2,800 | 19,292.00 | 0.06 |
| 60 | 601225 | 陕西煤业 | 600 | 15,462.00 | 0.04 |
| 61 | 600546 | 山煤国际 | 900 | 13,158.00 | 0.04 |
| 62 | 001696 | 宗申动力 | 700 | 7,448.00 | 0.02 |
| 63 | 600724 | 宁波富达 | 1,400 | 5,082.00 | 0.01 |
| 64 | 002267 | 陕天然气 | 600 | 4,536.00 | 0.01 |
| 65 | 603115 | 海星股份 | 400 | 4,160.00 | 0.01 |
| 66 | 300741 | 华宝股份 | 200 | 3,048.00 | 0.01 |
| 67 | 002004 | 华邦健康 | 800 | 3,040.00 | 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 | 830839 | 万通液压 | 1,139,423.96 | 2.75 |
| 2 | 832471 | 美邦科技 | 860,476.44 | 2.08 |
| 3 | 835174 | 五新隧装 | 751,686.00 | 1.82 |
| 4 | 871694 | 中裕科技 | 660,848.20 | 1.60 |
| 5 | 833075 | 柏星龙 | 611,173.23 | 1.48 |
| 6 | 834058 | 华洋赛车 | 587,005.58 | 1.42 |
| 7 | 835438 | 戈碧迦 | 582,806.82 | 1.41 |
| 8 | 838971 | 天马新材 | 576,443.24 | 1.39 |
| 9 | 430418 | 苏轴股份 | 542,022.86 | 1.31 |
| 10 | 836263 | 中航泰达 | 513,920.18 | 1.24 |
| 11 | 836239 | 长虹能源 | 509,006.29 | 1.23 |
| 12 | 430510 | 丰光精密 | 430,215.05 | 1.04 |
| 13 | 873806 | 云星宇 | 418,454.09 | 1.01 |
| 14 | 839167 | 同享科技 | 375,690.65 | 0.91 |
| 15 | 832491 | 奥迪威 | 345,022.20 | 0.83 |
| 16 | 832978 | 开特股份 | 290,748.87 | 0.70 |
| 17 | 837663 | 明阳科技 | 289,873.92 | 0.70 |
| 18 | 839493 | 并行科技 | 266,902.63 | 0.65 |
| 19 | 601398 | 工商银行 | 242,655.00 | 0.59 |
| 20 | 833171 | 国航远洋 | 234,071.04 | 0.57 |

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 | 834062 | 科润智控 | 1,289,135.60 | 3.12 |
| 2 | 832662 | 方盛股份 | 1,017,978.62 | 2.46 |
| 3 | 836260 | 中寰股份 | 976,142.88 | 2.36 |
| 4 | 833533 | 骏创科技 | 506,043.09 | 1.22 |
| 5 | 831195 | 三祥科技 | 497,497.44 | 1.20 |
| 6 | 832419 | 路斯股份 | 436,996.61 | 1.06 |
| 7 | 836263 | 中航泰达 | 410,007.97 | 0.99 |
| 8 | 873806 | 云星宇 | 388,602.51 | 0.94 |
| 9 | 839167 | 同享科技 | 381,560.08 | 0.92 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 10 | 831152 | 昆工科技 | 380,348.75 | 0.92 |
| 11 | 834599 | 同力股份 | 376,543.74 | 0.91 |
| 12 | 832491 | 奥迪威 | 344,220.84 | 0.83 |
| 13 | 872808 | 曙光数创 | 331,341.55 | 0.80 |
| 14 | 832469 | 富恒新材 | 302,027.02 | 0.73 |
| 15 | 430476 | 海能技术 | 294,129.77 | 0.71 |
| 16 | 832651 | 天罡股份 | 290,272.94 | 0.70 |
| 17 | 834415 | 恒拓开源 | 241,575.49 | 0.58 |
| 18 | 833171 | 国航远洋 | 220,135.89 | 0.53 |
| 19 | 871694 | 中裕科技 | 218,120.02 | 0.53 |
| 20 | 830974 | 凯大催化 | 199,677.90 | 0.48 |

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 | 12,570,686.01 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 10,519,665.02 |

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

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

北京并行科技股份有限公司因未依法履行其他职责在本报告编制前一年内受到北京证券交易所有限责任公司的监管关注。

河北美邦工程科技股份有限公司因未依法履行其他职责在本报告编制前一年内受到北京证券交易所有限责任公司的监管关注。

青岛丰光精密机械股份有限公司因财务数据错报在本报告编制前一年内收到北京证券交易所出具的警示函。

重庆康普化学工业股份有限公司因未依法履行其他职责在本报告编制前一年内受到重庆市长寿区应急管理局的公开处罚和责令整改。

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 | 15,296.93 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|-----------|
| 9 | 合计 | 15,296.93 |
|---|----|-----------|

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 (%) |
| 泰康北交所精选两年定开混合发起 A | 610 | 44,526.31 | 10,699,522.69 | 39.39 | 16,461,525.21 | 60.61 |
| 泰康北交所精选两年定开混合发起 C | 249 | 3,790.22 | 100,004.50 | 10.60 | 843,759.04 | 89.40 |
| 合计 | 839 | 33,497.99 | 10,799,527.19 | 38.43 | 17,305,284.25 | 61.57 |

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 | 泰康北交所精选两年定开混合发起 A | 3,289,689.20 | 12.1118 |
| | 泰康北交所精选两年定开混合发起 C | 2,621.03 | 0.2777 |
| | 合计 | 3,292,310.23 | 11.7144 |

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 泰康北交所精选两年定开混合发起 A | >100 |
| | 泰康北交所精选两年定开混合发起 C | 0 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 泰康北交所精选两年定开混合发起 A | 10~50 |
| | 泰康北交所精选两年定开混合发起 C | 0 |

| | | |
|--|----|--------------------|
| | 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 | - | - | - | - | - |
| 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 | 10,000,450.04 | 35.58 | 10,000,450.04 | 35.58 | 3 年 |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,450.04 | 35.58 | 10,000,450.04 | 35.58 | - |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 泰康北交所精选两年定开混合发起 A | 泰康北交所精选两年定开混合发起 C |
|---------------------------------------|----------------------|----------------------|
| 基金合同生效日 (2023 年 4 月 7 日) 基金份额总额 | 27,161,047.90 | 943,763.54 |
| 本报告期期初基金 份额总额 | 27,161,047.90 | 943,763.54 |
| 本报告期基金总申 购份额 | - | - |
| 减：本报告期基金 总赎回份额 | - | - |
| 本报告期基金拆分 变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金 份额总额 | 27,161,047.90 | 943,763.54 |

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

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 (%) | |
| 中信证券 | 3 | 22,996,899.03 | 100.00 | 17,274.72 | 100.00 | - |
| 财通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 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 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 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 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 汇丰前海 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 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 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 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 2 个交易单元, 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 (%) |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君 安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证 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 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 汇丰前 海证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------------|---|---|---|---|---|---|
| 开源证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏 源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证 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 | 泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金 2023 年第四季度报告 | 《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 01 月 19 日 |
| 2 | 泰康基金管理有限公司关于董事长变更的公告 | 《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 01 月 20 日 |
| 3 | 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 | 《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 03 月 25 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上海大智慧基金 | 《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网 | 2024 年 03 月 28 日 |

| | | | |
|---|---|-------------------------------|------------------|
| | 销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 站及基金管理人网站 | |
| 5 | 泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告 | 《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 03 月 29 日 |
| 6 | 泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年第一季度报告 | 《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 04 月 19 日 |
| 7 | 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 | 《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 05 月 23 日 |
| 8 | 泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金（泰康北交所精选两年定开混合发起 C 份额）基金产品资料概要更新 | 《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 06 月 26 日 |
| 9 | 泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金（泰康北交所精选两年定开混合发起 A 份额）基金产品资料概要更新 | 《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 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

| 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 | 20240101-20240630 | 10,000,450.04 | 0.00 | 0.00 | 10,000,450.04 | 35.58 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

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。

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北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- (二)《泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- (三)《泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (四)《泰康北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- (五)《泰康北交所精选两年定期开放混合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（《中国证券报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康基金管理有限公司

2024年8月29日