

泰康恒泰回报灵活配置混合型 证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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的情况.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	泰康恒泰回报混合	
基金主代码	002934	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 13 日	
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	351,300,858.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C
下属分级基金的交易代码:	002934	002935
报告期末下属分级基金的份额总额	244,880,956.46 份	106,419,901.57 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在合理控制风险的基础上，通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	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，力争利用主动式组合管理获得超过业绩比较基准的收益。 大类资产配置方面，本基金综合考虑宏观、政策、市场供求、投资价值比较、风险水平等因素，在股票与债券等资产类别之间进行动态资产配置。 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。 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。
业绩比较基准	中债新综合财富（总值）指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*20%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康资产管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	陆志俊
	联系电话	010-58753683	95559
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4001895522	95559
传真		010-57818785	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100033	200336
法定代表人		段国圣	任德奇

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	泰康资产管理有限责任公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 – 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 1 月 1 日 – 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,092,774.17	3,605,449.24
本期利润	5,798,212.47	3,698,182.09
加权平均基金份额本期利润	0.0373	0.0318
本期加权平均净值利润率	3.45%	2.80%
本期基金份额净值增长率	3.07%	3.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	20,199,392.11	13,942,588.75
期末可供分配基金份额利润	0.0825	0.1310
期末基金资产净值	265,080,348.57	120,362,490.32
期末基金份额净值	1.0825	1.1310
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	23.65%	29.19%

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) 本基金所述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

泰康恒泰回报混合 A

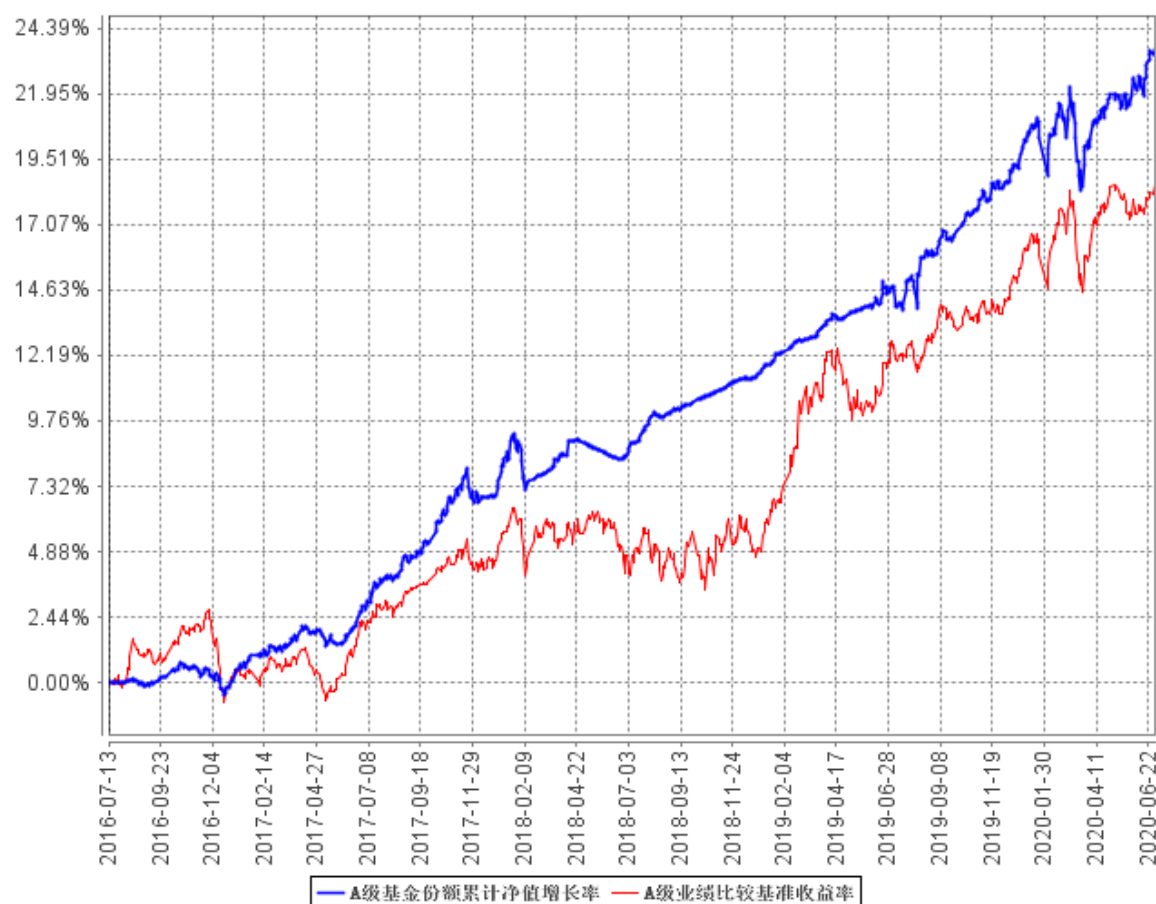
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.44%	0.24%	0.99%	0.19%	0.45%	0.05%
过去三个月	2.88%	0.21%	2.34%	0.20%	0.54%	0.01%
过去六个月	3.07%	0.30%	2.33%	0.28%	0.74%	0.02%
过去一年	7.95%	0.24%	5.93%	0.23%	2.02%	0.01%
过去三年	20.20%	0.16%	16.00%	0.24%	4.20%	-0.08%
自基金合同生效起至今	23.65%	0.15%	18.60%	0.23%	5.05%	-0.08%

泰康恒泰回报混合 C

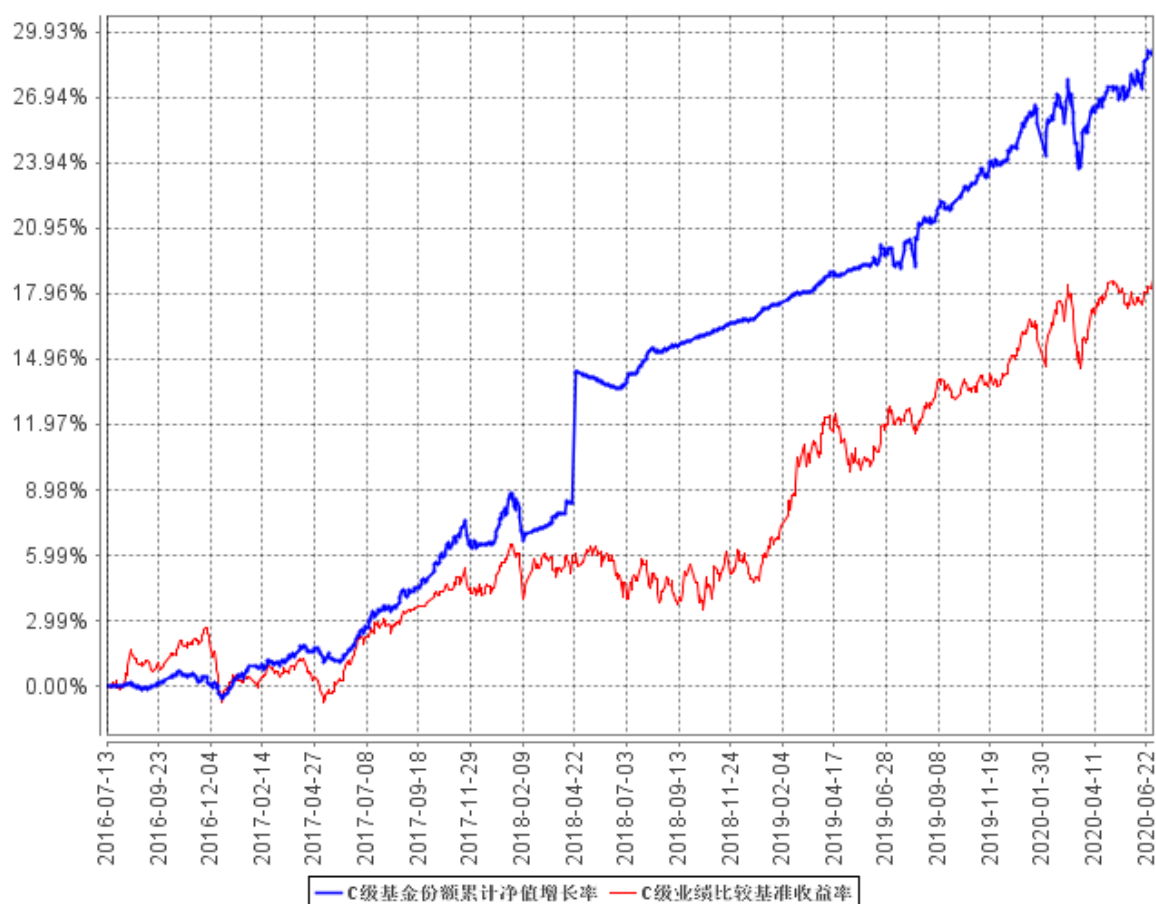
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.43%	0.24%	0.99%	0.19%	0.44%	0.05%
过去三个月	2.85%	0.21%	2.34%	0.20%	0.51%	0.01%
过去六个月	3.02%	0.30%	2.33%	0.28%	0.69%	0.02%
过去一年	7.83%	0.24%	5.93%	0.23%	1.90%	0.01%
过去三年	25.95%	0.26%	16.00%	0.24%	9.95%	0.02%
自基金合同生效起至今	29.19%	0.23%	18.60%	0.23%	10.59%	0.00%

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

A级基金份额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



C级基金份额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 07 月 13 日生效。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 2019 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 17000 亿元。除管理泰康委托的资产外，泰康资产管理的第三方业务总规模突破 9000 亿元，另类投资管理规模超过 3900 亿元。目前泰康资产退休金管理规模超过 3800 亿元，其中企业年金管理规模超过 2600 亿元，是国内最大的企业年金投资管理人。

2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。截至 2020 年 6 月 30 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康安业政策性金融债债券型证券投资基金、泰康信用精选债券型证券投资基金、泰康

安欣纯债债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金、泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)、泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金、泰康瑞丰纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康长江经济带债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰康申润一年持有期混合型证券投资基金共 45 只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
任慧娟	本基金基金经理	2016 年 7 月 13 日	—	13	任慧娟于 2015 年 8 月加入泰康资产管理有限责任公司，现担任公募事业部固定收益投资经理。2007 年 7 月至 2008 年 7 月在阳光财产保险公司资金运用部统计分析岗工作，2008 年 7 月至 2011 年 1 月在阳光保险集团资产管理中心历任风险管理岗、债券研究岗，2011 年 1 月起任固定收益投资经理，至 2015 年 8 月在阳光资产管理公司固定收益部投资部任高级投资经理。2015 年 12 月 9 日至今担任泰康薪意保货币市场基金基金经理。2016 年 5 月 9 日至今担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 7 月 13 日至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 24 日至今担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 21 日至 2019 年 5 月 8 日担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 8 日至今担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。2020 年

					6 月 30 日至今担任泰康申润一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
桂跃强	本基金基金经理、公募事业部权益投资负责人	2017 年 6 月 20 日	-	13	桂跃强于 2015 年 8 月加入泰康资产，现担任公募事业部股票投资负责人。 2007 年 9 月至 2015 年 8 月曾任职于新华基金管理有限公司，担任基金管理有限公司副总监。历任新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理。 2015 年 12 月 8 日至今担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 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 日至今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。
朱婕	本基金基金经理助理	2020 年 5 月 13 日	-	7	朱婕于 2015 年 4 月加入泰康资产，历任研究部股票研究员。现任公募事业部投资部股票投资经理。2013 年至 2015 年在中国国际金融有限公司研究部担任分析师。2020 年 5 月 13 日至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

注：1、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

2、基金管理人已于 2020 年 7 月 4 日发布《关于泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金变更基金经理的公告》，桂跃强先生自 2020 年 7 月 2 日起不再担任本基金基金经理。

3、基金管理人已于 2020 年 7 月 4 日发布《关于泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金变更基金经理的公告》，金宏伟先生自 2020 年 7 月 2 日起担任本基金基金经理。

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

宏观经济方面，2020 年上半年经济受到疫情的影响，呈现了先快速下行、再明显反弹的走势。国内疫情得到明显控制，但还是疫情还在深度发酵，中国的生产能力优势凸显，承担了世界工厂的角色，出口部门表现出较强的韧性；国内复工复产较为顺利，基建和地产支撑经济，消费和制造业表现较弱。通胀方面，CPI 高位回落，PPI 明显下行，随后有所企稳；货币条件方面，在宽货币宽信用政策的支持下，M2 和社融的增速持续上行，汇率总体稳定。

债券市场方面，上半年利率先下再上，总体有所下行。年初随着海内外疫情的持续发酵，各国央行采取了宽松的货币政策，中国央行也多次降准降息，叠加对于国内外基本面的担忧，利率显著下行；4 月底开始，随着海内外复工复产，基本面数据快速修复；同时中国货币政策逐步强调适度，注重金融风险防范，利率明显回调。总体来看，上半年 10Y 国债下行 32bp，10Y 国开下行 48bp。

权益市场方面，一季度新冠肺炎对海外经济体的影响超出之前的预期，由于外需的不确定性以及防控海外病例倒灌的影响，中国经济活动的复苏可能还要等待 1-2 个季度。对股票市场谨慎乐观，虽然短期权益市场的盈利下调风险还需要释放，但中长期而言中国经济相比全球其他经济体依然有韧性，宽松的政策环境也对冲了部分风险偏好的下降。进入二季度，随着新冠肺炎疫情在中国得到了有效的控制，4、5 月份的数据显示中国经济韧性强于预期，中国庞大的消费市场和在全球产业链中不断上升的地位为后续的复苏提供了持续的动力，权益市场也探底回升。从涨跌幅数据和板块上来看，上证综指下跌 1.82%，沪深 300 上涨 2.01%，中小板指上涨 22.00%，创业板指上涨 36.19%。其中，消费、食品饮料、医药、电子等板块表现相对较好，石油石化、金融、煤炭等行业表现不佳。

固收方面，本基金在报告期内以获取持有期收益为主要目标，保持比较高的信用债配置比例和较高的杠杆比例，适当参与利率债操作。信用债方面，精挑细选优质主体，严防信用尾部风险。

权益投资方面，在本期，基金在仓位上相机而动，整体小幅加仓。在品种上我们继续坚持原有思路，仍以食品饮料、医药生物、家电为主，聚焦内需为主、具有明确需求特征且具有竞争优势的行业中的龙头个股，重点关注品牌消费品、创新科技制造属性的医药、比较竞争优势的中国

制造等行业，均衡策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康恒泰回报 A 基金份额净值为 1.0825 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.07%;截至本报告期末泰康恒泰回报 C 基金份额净值为 1.1310 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.02%;同期业绩比较基准增长率为 2.33%。

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，基本面将延续复苏，斜率有所放缓。基建和地产将延续 2 季度的良好表现，但由于政策对于房地产市场的前瞻性防范，预计走向过热的可能性不高；出口将继续呈现出韧性；消费和服务业在消费场景逐步打开、居民消费意愿逐步提升的背景下，预计存在一定的改善空间，但居民收入形成制约。政策预计延续相机抉择的基调，考虑到当前的基本面环境，政策进一步放松或明显收紧的概率都不大，总体可能较为平稳。

债券市场方面，利率在经历了大幅的调整之后，预计后期有望进入到偏震荡的走势；如果基本面复苏力度较好，则债券市场可能震荡偏弱，但重现剧烈调整的可能性不大。因此，久期策略不宜过度进取，关注基本面和市场调整的相对变化情况。信用债将以票息策略为主，精选个券仍是主要思路。

权益市场方面，我们欣喜地看到了优秀的上市公司经受住了疫情的考验，并且在这次非正常“供给侧出清”的过程中进一步巩固了竞争优势。但我们也观察到，受益于全球低利率环境，优质公司的估值大幅扩张并不断创历史新高，A 股结构性分化更加极端。

我们将紧密跟踪经济和市场的动态变化，力争把握机会、规避风险，为基金持有人取得较好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，泰康恒泰回报混合 A 实施利润分配的金额为 5,970,853.86 元，泰康恒泰回报混合 C 实施利润分配的金额为 5,866,581.20 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

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合规守信情况声明

2020 上半年度，基金托管人在泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2020 上半年度，泰康资产管理有限责任公司在泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，泰康恒泰回报混合 A 实施利润分配的金额为 5,970,853.86 元，泰康恒泰回报混合 C 实施利润分配的金额为 5,866,581.20 元，符合基金合同的规定。

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

2020 上半年度，由泰康资产管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	714,444.62	217,548.16
结算备付金		3,845,403.77	4,312,132.85
存出保证金		38,733.73	76,316.30
交易性金融资产	6.4.7.2	417,097,248.01	321,489,813.76
其中：股票投资		89,246,073.79	57,880,253.46
基金投资		-	-
债券投资		327,851,174.22	263,609,560.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,410,710.53	5,834,048.95
应收股利		-	-
应收申购款		48,115,248.99	65,069.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		474,221,789.65	331,994,929.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		40,079,759.38	59,899,565.50
应付证券清算款		48,173,157.96	722,075.21
应付赎回款		139,980.72	22,866.05
应付管理人报酬		167,913.33	184,093.64
应付托管费		27,985.53	30,682.26
应付销售服务费		9,815.81	16,993.21
应付交易费用	6.4.7.7	41,619.33	31,102.28
应交税费		32,776.64	39,787.48

应付利息		17,378.92	10,787.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	88,563.14	49,012.73
负债合计		88,778,950.76	61,006,966.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	351,300,858.03	239,224,403.05
未分配利润	6.4.7.10	34,141,980.86	31,763,560.18
所有者权益合计		385,442,838.89	270,987,963.23
负债和所有者权益总计		474,221,789.65	331,994,929.28

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，泰康恒泰回报混合 A 基金份额净值 1.0825 元，份额总额 244,880,956.46 份；泰康恒泰回报混合 C 基金份额净值 1.1310 元，份额总额 106,419,901.57 份；泰康恒泰回报混合份额总额合计为 351,300,858.03 份。

6.2 利润表

会计主体：泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		11,700,559.38	5,489,413.62
1.利息收入		6,398,347.51	3,611,665.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,822.22	12,723.23
债券利息收入		6,369,670.34	3,587,059.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		854.95	11,881.99
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,488,388.91	2,360,148.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,687,147.42	283,195.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	452,403.11	1,561,513.96
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,348,838.38	515,439.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	798,171.15	-624,197.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	15,651.81	141,797.40
减：二、费用		2,204,164.82	1,231,890.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	897,307.31	521,273.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	149,551.16	86,878.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	66,044.23	42,899.92
4. 交易费用	6.4.7.19	122,978.01	121,483.58
5. 利息支出		841,174.97	340,863.14
其中：卖出回购金融资产支出		841,174.97	340,863.14
6. 税金及附加		21,651.53	10,309.34
7. 其他费用	6.4.7.20	105,457.61	108,182.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,496,394.56	4,257,522.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,496,394.56	4,257,522.72

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	239,224,403.05	31,763,560.18	270,987,963.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,496,394.56	9,496,394.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	112,076,454.98	4,719,461.18	116,795,916.16
其中：1.基金申购款	197,196,264.65	15,527,196.10	212,723,460.75
2.基金赎回款	-85,119,809.67	-10,807,734.92	-95,927,544.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-11,837,435.06	-11,837,435.06

基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	351,300,858.03	34,141,980.86	385,442,838.89
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	216,709,660.49	8,953,294.82	225,662,955.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,257,522.72	4,257,522.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	32,508,036.87	7,902,384.85	40,410,421.72
其中: 1.基金申购款	151,833,906.90	11,991,286.66	163,825,193.56
2.基金赎回款	-119,325,870.03	-4,088,901.81	-123,414,771.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	249,217,697.36	21,113,202.39	270,330,899.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1262号《关于准予泰康恒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《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 502,345,524.74 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 897 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 502,355,699.92 份基金份额,其中认购资金利息折合 10,175.18 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康资产管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债、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、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、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、资产支持证券、债券回购等)、银行存款(包括协议存款、定期存款)、同业存单、国债期货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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0%-95%;基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中债新综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 75%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%+金融机构人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康恒泰回报灵活配置混合型

证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以

2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	714,444.62
定期存款	—
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	-
合计：	714,444.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		85,905,519.71	89,246,073.79	3,340,554.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	103,603,466.80	102,837,374.22	-766,092.58
	银行间市场	226,374,934.38	225,013,800.00	-1,361,134.38
	合计	329,978,401.18	327,851,174.22	-2,127,226.96
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		415,883,920.89	417,097,248.01	1,213,327.12

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	308.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,730.40
应收债券利息	4,408,254.56
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	400.12

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	17.40
合计	4,410,710.53

6.4.7.6 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	20,865.93
银行间市场应付交易费用	20,753.40
合计	41,619.33

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.02
应付证券出借违约金	-
预提费用	88,563.12
合计	88,563.14

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰康恒泰回报混合 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,244,621.26	98,244,621.26
本期申购	187,267,923.12	187,267,923.12
本期赎回(以“-”号填列)	-40,631,587.92	-40,631,587.92
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	244,880,956.46	244,880,956.46

金额单位：人民币元

泰康恒泰回报混合 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	140,979,781.79	140,979,781.79
本期申购	9,928,341.53	9,928,341.53
本期赎回(以“-”号填列)	-44,488,221.75	-44,488,221.75
— 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	106,419,901.57	106,419,901.57

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰康恒泰回报混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,469,999.78	-322,599.09	10,147,400.69
本期利润	5,092,774.17	705,438.30	5,798,212.47
本期基金份额交易产生的变动数	10,919,188.99	-694,556.18	10,224,632.81
其中：基金申购款	14,993,805.07	-721,437.01	14,272,368.06
基金赎回款	-4,074,616.08	26,880.83	-4,047,735.25
本期已分配利润	-5,970,853.86	—	-5,970,853.86
本期末	20,511,109.08	-311,716.97	20,199,392.11

单位：人民币元

泰康恒泰回报混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,061,065.70	-444,906.21	21,616,159.49
本期利润	3,605,449.24	92,732.85	3,698,182.09
本期基金份额交易产生的变动数	-5,744,795.50	239,623.87	-5,505,171.63
其中：基金申购款	1,424,600.55	-169,772.51	1,254,828.04
基金赎回款	-7,169,396.05	409,396.38	-6,759,999.67
本期已分配利润	-5,866,581.20	—	-5,866,581.20
本期末	14,055,138.24	-112,549.49	13,942,588.75

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,812.22
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	21,394.31
其他	3,615.69
合计	27,822.22

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	50,717,242.91
减：卖出股票成本总额	48,030,095.49
买卖股票差价收入	2,687,147.42

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	452,403.11
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	452,403.11

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	280,404,714.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	274,074,236.72

减：应收利息总额	5,878,074.23
买卖债券差价收入	452,403.11

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期，本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,348,838.38
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	1,348,838.38

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	798,171.15
——股票投资	3,266,112.43
——债券投资	-2,467,941.28
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
期货投资	-
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	798,171.15

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	14,103.80
基金转换费收入	1,548.01
合计	15,651.81

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	115,148.01
银行间市场交易费用	7,830.00
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	122,978.01

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	—
其他	600.00
债券帐户维护费	18,000.00
银行费用	7,294.49
合计	105,457.61

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内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
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	897,307.31	521,273.25
其中：支付销售机构的客户维护费	29,701.35	14,154.11

注：支付基金管理人泰康资产管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	149,551.16	86,878.85

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C	合计
交通银行	-	31.22	31.22
泰康资产管理有限责任公司	-	54,693.97	54,693.97
合计	-	54,725.19	54,725.19
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C	合计
交通银行	-	12.89	12.89
泰康资产管理有限责任公司	-	37,357.17	37,357.17
合计	-	37,370.06	37,370.06

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 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰康资产管理有限责任公司，再由泰康资产管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
交通银行	714,444.62	2,812.22	177,932.06	1,807.61

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行约定利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按中国证券登记结算有限责任公司与交通银行商定利率计息。于 2020 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

泰康恒泰回报混合 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 3 月 23 日	-	2020 年 3 月 23 日	0.5270	3,081,425.70	2,889,428.16	5,970,853.86	
合计	-	-	-	0.5270	3,081,425.70	2,889,428.16	5,970,853.86	

泰康恒泰回报混合 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 3 月 23 日	-	2020 年 3 月 23 日	0.5510	1,343,126.74	4,523,454.46	5,866,581.20	
合计	-	-	-	0.5510	1,343,126.74	4,523,454.46	5,866,581.20	

6.4.12 期末（2020 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	可流 通日	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
688568	中科 星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	网下新 股流通 受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威 尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	网下新 股流通 受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688027	国盾 量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	网下新 股流通 受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川 物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月	网下新 股流通	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-

		日	1 日	受限						
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	网下新股流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
688555	泽达易盛	2020 年 6 月 12 日	2020 年 12 月 23 日	新股锁定期流通受限	19.49	56.80	3,004	58,547.96	170,627.20	-
688516	奥特维	2020 年 5 月 14 日	2020 年 11 月 23 日	新股锁定期流通受限	23.28	43.10	3,440	80,083.20	148,264.00	-

注：1. 截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

2. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

3. 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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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 27,079,759.38 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
190205	19 国开 05	2020 年 7 月 1 日	100.83	100,000	10,083,000.00
200206	20 国开 06	2020 年 7 月 1 日	99.16	180,000	17,848,800.00
合计				280,000	27,931,800.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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 13,000,000.00 元，于 2020 年 7 月 1 日到期。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

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

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行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所

进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	0.00	30,107,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	30,107,000.00

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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	114,172,450.00	81,088,241.10
AAA 以下	175,669,924.22	138,396,119.20
未评级	0.00	0.00
合计	289,842,374.22	219,484,360.30

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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 2020 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超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 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，此外还持有银行存款、结算备付金及存出保证金等利率敏感性资产，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 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	714,444.62	-	-	-	714,444.62
结算备付金	3,845,403.77	-	-	-	3,845,403.77
存出保证金	38,733.73	-	-	-	38,733.73
交易性金融资产	137,133,960.00	174,497,381.00	16,219,833.22	89,246,073.79	417,097,248.01
应收利息	-	-	-	4,410,710.53	4,410,710.53
应收申购款	48,004,940.36	-	-	110,308.63	48,115,248.99
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	189,737,482.48	174,497,381.00	16,219,833.22	93,767,092.95	474,221,789.65

负债					
卖出回购金融资产款	40,079,759.38	-	-	-	40,079,759.38
应付证券清算款	-	-	-	-48,173,157.96	48,173,157.96
应付赎回款	-	-	-	139,980.72	139,980.72
应付管理人报酬	-	-	-	167,913.33	167,913.33
应付托管费	-	-	-	27,985.53	27,985.53
应付销售服务费	-	-	-	9,815.81	9,815.81
应付交易费用	-	-	-	41,619.33	41,619.33
应付利息	-	-	-	17,378.92	17,378.92
应交税费	-	-	-	32,776.64	32,776.64
其他负债	-	-	-	88,563.14	88,563.14
负债总计	40,079,759.38	-	-	-48,699,191.38	88,778,950.76
利率敏感度缺口	149,657,723.10	174,497,381.00	16,219,833.22	45,067,901.57	385,442,838.89
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	217,548.16	-	-	-	217,548.16
结算备付金	4,312,132.85	-	-	-	4,312,132.85
存出保证金	76,316.30	-	-	-	76,316.30
交易性金融资产	123,533,693.00	139,134,000.00	941,867.30	57,880,253.46	321,489,813.76
应收利息	-	-	-	5,834,048.95	5,834,048.95
应收申购款	1,000.00	-	-	64,069.26	65,069.26
资产总计	128,140,690.31	139,134,000.00	941,867.30	63,778,371.67	331,994,929.28
负债					
卖出回购金融资产款	59,899,565.50	-	-	-	59,899,565.50
应付证券清算款	-	-	-	722,075.21	722,075.21
应付赎回款	-	-	-	22,866.05	22,866.05
应付管理人报酬	-	-	-	184,093.64	184,093.64
应付托管费	-	-	-	30,682.26	30,682.26
应付销售服务费	-	-	-	16,993.21	16,993.21
应付交易费用	-	-	-	31,102.28	31,102.28
应付利息	-	-	-	10,787.69	10,787.69
应交税费	-	-	-	39,787.48	39,787.48
其他负债	-	-	-	49,012.73	49,012.73
负债总计	59,899,565.50	-	-	1,107,400.55	61,006,966.05
利率敏感度缺口	68,241,124.81	139,134,000.00	941,867.30	62,670,971.12	270,987,963.23

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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	市场利率下调 0.25%	1,454,491.92	713,165.63
	市场利率上调 0.25%	-1,439,464.56	-708,816.18

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。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-95%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	89,246,073.79	23.15	57,880,253.46	21.36
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	89,246,073.79	23.15	57,880,253.46	21.36

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准中的权益指数上涨 5%	3,247,212.56	2,252,721.60
	业绩比较基准中的权益指数下降 5%	-3,247,212.56	-2,252,721.60

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 102,029,701.52 元，属于第二层次的余额为 315,067,546.49 元，无属于第三层次的余额（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 50,925,189.98 元，属于第二层次的余额为 270,564,623.78 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次直接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；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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，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	89,246,073.79	18.82
	其中：股票	89,246,073.79	18.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	327,851,174.22	69.13
	其中：债券	327,851,174.22	69.13
	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	4,559,848.39	0.96
8	其他各项资产	52,564,693.25	11.08
9	合计	474,221,789.65	100.00

注：本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	35,082,348.13	9.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,343,729.08	3.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,225,075.00	1.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	349,261.40	0.09
J	金融业	31,892,804.84	8.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,352,855.34	1.13
S	综合	-	-
	合计	89,246,073.79	23.15

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

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	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	651,054	12,330,962.76	3.20
2	600519	贵州茅台	6,200	9,069,856.00	2.35
3	600887	伊利股份	258,300	8,040,879.00	2.09
4	600309	万华化学	154,000	7,698,460.00	2.00
5	600036	招商银行	214,300	7,226,196.00	1.87
6	601288	农业银行	2,038,700	6,890,806.00	1.79
7	601318	中国平安	89,700	6,404,580.00	1.66
8	601658	邮储银行	1,258,878	5,753,072.46	1.49
9	600009	上海机场	72,500	5,225,075.00	1.36
10	300760	迈瑞医疗	16,000	4,891,200.00	1.27
11	601098	中南传媒	411,423	4,352,855.34	1.13
12	002311	海大集团	74,730	3,556,400.70	0.92
13	601398	工商银行	633,104	3,152,857.92	0.82
14	601916	浙商银行	294,195	1,159,128.30	0.30
15	601077	渝农商行	147,778	697,512.16	0.18
16	601988	中国银行	174,900	608,652.00	0.16
17	603288	海天味业	4,756	591,646.40	0.15
18	688026	洁特生物	4,433	385,449.35	0.10
19	688159	有方科技	3,341	181,048.79	0.05
20	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.05
21	688555	泽达易盛	3,004	170,627.20	0.04
22	688516	奥特维	3,440	148,264.00	0.04
23	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03

24	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.03
25	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
26	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
27	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
28	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601988	中国银行	16,979,825.00	6.27
2	600900	长江电力	8,288,059.00	3.06
3	600036	招商银行	6,869,921.00	2.54
4	600309	万华化学	6,838,890.00	2.52
5	603195	公牛集团	6,069,412.55	2.24
6	601398	工商银行	5,015,676.45	1.85
7	600519	贵州茅台	4,999,784.00	1.85
8	600009	上海机场	4,997,806.00	1.84
9	601288	农业银行	4,854,180.00	1.79
10	002311	海大集团	3,431,092.70	1.27
11	601658	邮储银行	2,427,075.00	0.90
12	600233	圆通速递	474,176.16	0.17
13	002439	启明星辰	452,790.80	0.17
14	688158	优刻得	309,537.45	0.11
15	688599	天合光能	304,025.28	0.11
16	688106	金宏气体	253,717.20	0.09
17	688566	吉贝尔	234,104.58	0.09
18	688520	神州细胞	228,708.80	0.08
19	688568	中科星图	178,634.20	0.07
20	688505	复旦张江	160,303.45	0.06

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	601988	中国银行	15,723,947.00	5.80
2	601398	工商银行	7,851,336.00	2.90
3	603195	公牛集团	6,276,163.39	2.32
4	601318	中国平安	4,353,327.00	1.61
5	601288	农业银行	3,632,523.00	1.34
6	600900	长江电力	1,325,811.00	0.49
7	600887	伊利股份	835,744.00	0.31
8	688520	神州细胞	699,994.20	0.26
9	688106	金宏气体	668,483.41	0.25
10	688599	天合光能	659,578.24	0.24
11	688158	优刻得	648,668.62	0.24
12	688505	复旦张江	634,880.34	0.23
13	600233	圆通速递	489,582.70	0.18
14	688312	燕麦科技	468,395.33	0.17
15	688166	博瑞医药	455,664.15	0.17
16	688566	吉贝尔	426,663.56	0.16
17	002439	启明星辰	422,254.85	0.16
18	688100	威胜信息	408,142.05	0.15
19	688518	联赢激光	378,361.07	0.14
20	688051	佳华科技	370,560.00	0.14

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	76,129,803.39
卖出股票收入（成交）总额	50,717,242.91

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	38,008,800.00	9.86
	其中：政策性金融债	38,008,800.00	9.86
4	企业债券	95,141,400.00	24.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	180,888,000.00	46.93
7	可转债（可交换债）	13,812,974.22	3.58
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	327,851,174.22	85.06

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	127902	18 铁道 19	200,000	20,780,000.00	5.39
2	200206	20 国开 06	180,000	17,848,800.00	4.63
3	101801098	18 西永 MTN002	100,000	10,346,000.00	2.68
4	101800851	18 谷财 MTN001	100,000	10,252,000.00	2.66
5	101800216	18 温工投 MTN001	100,000	10,248,000.00	2.66

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编

制前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	38,733.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,410,710.53
5	应收申购款	48,115,248.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,564,693.25

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	113011	光大转债	1,710,900.00	0.44
2	127011	中鼎转2	820,160.00	0.21
3	113019	玲珑转债	618,600.00	0.16
4	128059	视源转债	597,780.00	0.16
5	113537	文灿转债	564,550.00	0.15
6	128067	一心转债	561,640.00	0.15
7	110053	苏银转债	529,600.00	0.14
8	113553	金牌转债	479,880.00	0.12
9	113543	欧派转债	435,365.00	0.11
10	128035	大族转债	428,240.00	0.11
11	128042	凯中转债	315,060.00	0.08
12	123036	先导转债	311,218.10	0.08
13	110059	浦发转债	305,550.00	0.08
14	127005	长证转债	291,600.00	0.08
15	110060	天路转债	280,349.10	0.07
16	110064	建工转债	254,300.00	0.07
17	110062	烽火转债	249,420.00	0.06
18	113550	常汽转债	247,120.00	0.06

19	128046	利尔转债	239,631.00	0.06
20	110048	福能转债	215,100.00	0.06
21	113029	明阳转债	171,705.00	0.04
22	110041	蒙电转债	159,870.00	0.04
23	113026	核能转债	149,910.00	0.04
24	127013	创维转债	118,520.00	0.03
25	128084	木森转债	108,962.70	0.03
26	113519	长久转债	106,620.00	0.03
27	113558	日月转债	99,480.00	0.03

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 恒 泰 回 报 混合 A	170	1,440,476.21	243,603,607.84	99.48%	1,277,348.62	0.52%
泰 康 恒 泰 回 报 混合 C	196	542,958.68	100,503,874.93	94.44%	5,916,026.64	5.56%
合计	361	973,132.57	344,107,482.77	97.95%	7,193,375.26	2.05%

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	泰康恒泰 回报混合 A	476,982.00	0.1948%
	泰康恒泰 回报混合 C	280,406.60	0.2635%
	合计	757,388.60	0.2156%

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的情况

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	泰康恒泰回报混合 A	10~50
	泰康恒泰回报混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开 放式基金	泰康恒泰回报混合 A	0
	泰康恒泰回报混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康恒泰回报混 合 A	泰康恒泰回报混 合 C
基金合同生效日（2016 年 7 月 13 日）基金份 额总额	2,345,699.92	500,010,000.00
本报告期期初基金份额总额	98,244,621.26	140,979,781.79
本报告期基金总申购份额	187,267,923.12	9,928,341.53
减：本报告期基金总赎回份额	40,631,587.92	44,488,221.75
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	244,880,956.46	106,419,901.57

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	117,719,958.11	96.81%	33,096.14	97.03%	-
光大证券	2	3,878,997.55	3.19%	1,013.60	2.97%	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：（1）经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；（2）财务状况和经营状况良好；（3）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；（4）有较强的研究能力，

能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；（5）能及时提供准确的信息资讯服务；（6）满足基金运作的保密要求；（7）符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力和服务质量进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行。

3、本报告期内本基金租用券商交易单元变更情况：无。

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
招商证券	106,603,654.77	85.94%	2,294,800,000.00	87.38%	—	—
光大证券	17,442,165.27	14.06%	331,500,000.00	12.62%	—	—

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	泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下开放式基金在北京蛋卷基金销售有限公司赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020年3月9日
2	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入及定投）业务公告	《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	2020年3月17日
3	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第一次分红公告	《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	2020年3月20日
4	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入及定投）业务公告	《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	2020年3月23日
5	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加南京苏宁基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020年3月30日
6	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人	2020年4月13日

	购（含转换转入及定投）业务公告	网站	
7	泰康资产管理有限责任公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 4 月 28 日
8	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 5 月 6 日
9	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加北京汇成基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 5 月 27 日
10	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金暂停非直销销售机构大额申购（含转换转入及定投）业务公告	《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	2020 年 6 月 25 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	20200103 – 20200107	47,807,699.81	2,430,301.93	0.00	50,238,001.74	14.30%
	2	20200226 – 20200409	47,807,699.81	2,430,301.93	0.00	50,238,001.74	14.30%
	3	20200318 – 20200409	30,111,982.80	47,384,278.30	30,111,982.80	47,384,278.30	13.49%
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恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- （二）《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- （三）《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- （四）《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

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。

泰康资产管理有限责任公司

2020 年 8 月 31 日