

泰康恒泰回报灵活配置混合型
证券投资基金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 日

§1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	158,151,930.23 份
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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>固定收益类投资方面，本基金通过分析宏观经济运行情况、判断经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。另外，本基金在分析各类债券资产的信用风险、流动性风险及其收益率水平的基础上，通过比较或合理预期各类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整优先配置的资产类别和配置比例。</p> <p>权益类投资方面，在严格控制风险、保持资产流</p>

	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。	
基金管理人	泰康基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
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	10,916,892.38 份	147,235,037.85 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C
1. 本期已实现收益	102,343.80	1,335,259.29
2. 本期利润	238,802.62	3,430,927.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0208	0.0225
4. 期末基金资产净值	11,443,584.33	160,605,826.79
5. 期末基金份额净值	1.0482	1.0908

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰康恒泰回报混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标	①-③	②-④
----	--------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

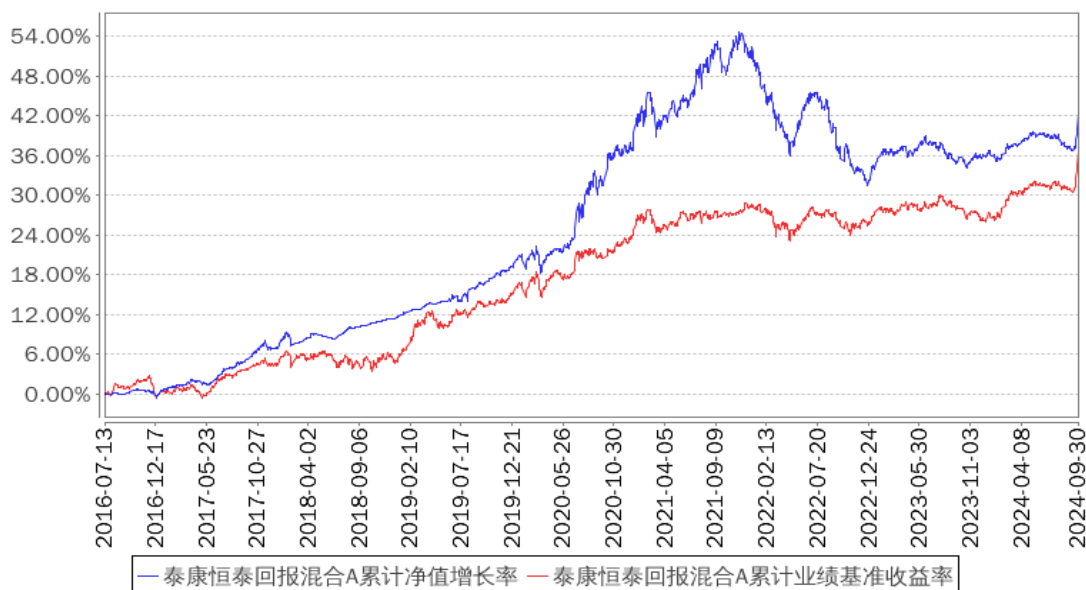
				准差④		
过去三个月	2.26%	0.29%	3.86%	0.28%	-1.60%	0.01%
过去六个月	3.40%	0.22%	4.79%	0.22%	-1.39%	0.00%
过去一年	4.83%	0.19%	6.66%	0.20%	-1.83%	-0.01%
过去三年	-4.86%	0.31%	7.48%	0.21%	-12.34%	0.10%
过去五年	21.78%	0.36%	20.66%	0.23%	1.12%	0.13%
自基金合同 生效起至今	42.33%	0.29%	36.50%	0.23%	5.83%	0.06%

泰康恒泰回报混合 C

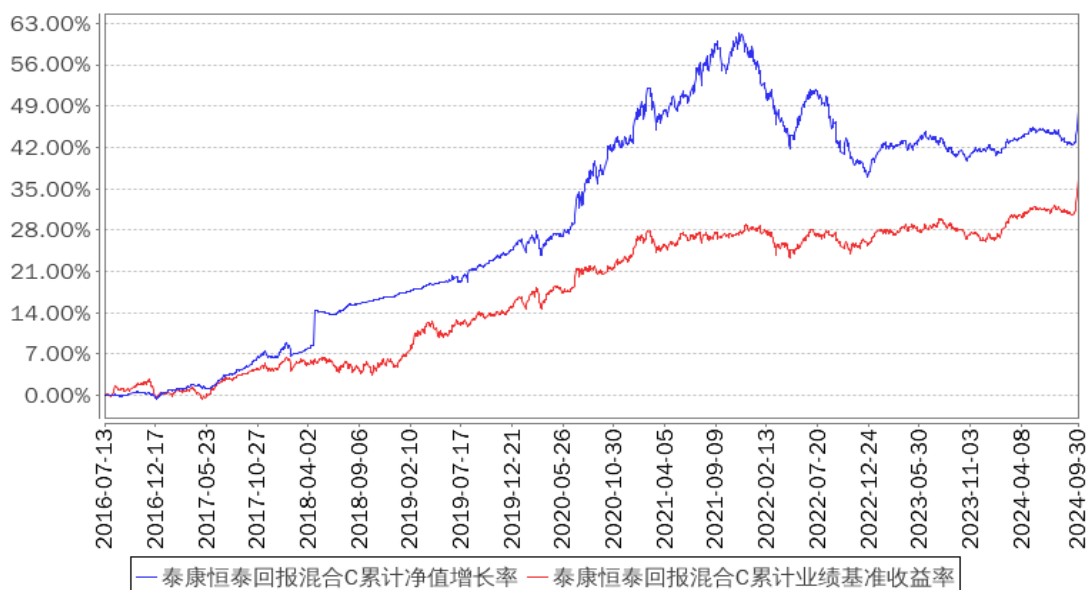
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.24%	0.29%	3.86%	0.28%	-1.62%	0.01%
过去六个月	3.35%	0.22%	4.79%	0.22%	-1.44%	0.00%
过去一年	4.73%	0.19%	6.66%	0.20%	-1.93%	-0.01%
过去三年	-5.11%	0.31%	7.48%	0.21%	-12.59%	0.10%
过去五年	21.20%	0.36%	20.66%	0.23%	0.54%	0.13%
自基金合同 生效起至今	48.11%	0.31%	36.50%	0.23%	11.61%	0.08%

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

泰康恒泰回报混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰康恒泰回报混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 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。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

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

		任职日期	离任日期	年限	
任慧娟	本基金基金经理	2016 年 7 月 13 日	-	17 年	任慧娟于 2015 年 8 月加入泰康公募，现任泰康基金固定收益基金经理。曾任阳光财产保险公司资产管理中心固定收益投资部高级投资经理。2015 年 12 月 9 日至 2022 年 10 月 26 日担任泰康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。2022 年 8 月 1 日至今担任泰康丰盛纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 20 日至 2024 年 1 月 12 日担任泰康安泓纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 28 日至 2024 年 4 月 16 日担任泰康丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
王凌力	本基金基金经理	2024 年 7 月 4 日	-	9 年	王凌力于 2024 年 4 月加入泰康基金，现任股票基金经理。曾任财通证券资产管理有限公司研究员，上海汽车集团股权投资有限公司投资经理助理，上汽顾臻（上海）资产管理有限公司投资经理等职务。2024 年 7 月 4 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。
金宏伟	本基金基金经理	2020 年 7 月 2 日	2024 年 7 月 4 日	12 年	金宏伟于 2016 年 12 月加入泰康公募，现任泰康基金股票基金经理。曾任中钢集团工程总包项目经理、工程师、国际商务师，新华基金管理有限公司行业研究员、中上游行业组长、中游及 TMT 行业组长、研究部总监助理、专户投资部投资经理等职务。2017 年 8 月 28 日至 2023 年 2 月 7 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。2017 年 8 月 28 日至 2019 年 5 月 9 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。2020 年 7 月 2 日至 2024 年 7 月 4 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。2020 年 7 月 24 日至今担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 10 日至今担任泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 7 日至 2024 年 1 月 5 日担任泰康裕泰债券型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 1 日至 2024 年 4 月 16 日担任泰康招享混合型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 29 日至今担任泰康景气行业混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，三季度延续了弱势运行、结构分化的特征。偏需求侧的消费增速表现较为疲

弱，M2 和社融等金融指标继续下行，通胀维持低位，整体有所承压。9 月底的一揽子政策和政治局会议一定程度上扭转了低迷的市场预期，提振了信心，后续关注政策如何落地、以及经济企稳的可能。

债券市场方面，收益率先是震荡下行，在 9 月底出现了较为快速的抬升。央行买短卖长的操作，在给市场提供流动性支撑的同时，也一定程度上减缓了长端利率下行的节奏；但在经济需求不足和资产荒的背景下，利率总体趋势向下。在 9 月底的预期扭转之后，资产再平衡的行为在短期演绎得较为剧烈，利率有所回调。

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

权益市场方面，回顾三季度，经济增长延续弱势，国内信用整体收缩，政策力度则不断加大，尤其九月下旬出台一系列强有力政策，扭转了市场预期；海外美联储迎来降息周期，为全球流动性宽松提供了可能。从市场来看，大盘三季度先抑后扬，尤其九月下旬市场开启了快速上涨，上证指数上涨 12.44%，沪深 300 上涨 16.07%，创业板指上涨 29.21%。

权益投资方面，本期基金保持合理的权益仓位，整体有所增加。在具体配置上，行业相对均衡，科技、高端制造、消费、医药、交运、公用事业等均有配置，个股则着重基本面研究，重点选择经营情况良好、估值合理的个股进行配置；力求通过自下而上深入研究、寻找基本面优质的企业并紧密跟踪其经营变化，从而获得长期回报。

4.5 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 1.0482 元，本报告期基金 A 份额净值增长率为 2.26%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.0908 元，本报告期基金 C 份额净值增长率为 2.24%；同期业绩比较基准增长率为 3.86%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金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者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	31,909,022.88	17.09
	其中：股票	31,909,022.88	17.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	152,038,285.92	81.42
	其中：债券	152,038,285.92	81.42
	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	2,339,088.17	1.25
8	其他资产	442,722.95	0.24
9	合计	186,729,119.92	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,088,400.00	0.63
C	制造业	21,755,317.88	12.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,984,895.00	1.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	969,760.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	2,935,700.00	1.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	822,750.00	0.48
J	金融业	-	-
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	2,352,200.00	1.37
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	31,909,022.88	18.55
----	---------------	-------

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601865	福莱特	100,000	2,022,000.00	1.18
2	601139	深圳燃气	262,900	1,984,895.00	1.15
3	002126	银轮股份	100,000	1,950,000.00	1.13
4	600765	中航重机	96,300	1,948,149.00	1.13
5	600150	中国船舶	40,000	1,670,800.00	0.97
6	002352	顺丰控股	35,000	1,574,300.00	0.92
7	002831	裕同科技	60,004	1,543,302.88	0.90
8	002371	北方华创	4,000	1,463,920.00	0.85
9	300896	爱美客	6,000	1,413,600.00	0.82
10	603871	嘉友国际	60,000	1,361,400.00	0.79

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	50,907,866.85	29.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	77,692,834.59	45.16
	其中：政策性金融债	10,111,830.60	5.88
4	企业债券	10,232,393.43	5.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,086,694.25	2.96
7	可转债（可交换债）	8,118,496.80	4.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	152,038,285.92	88.37

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	240011	24 附息国债 11	500,000	50,907,866.85	29.59
2	232380006	23 中行二级资本债 01A	150,000	15,831,947.67	9.20
3	2028044	20 广发银行二级 01	100,000	10,602,072.13	6.16
4	092280134	22 工行二级资	100,000	10,463,770.49	6.08

		本债 04A			
5	185152	21 海控 02	100,000	10,232,393.43	5.95

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

广发银行股份有限公司信用卡中心因新增信用卡业务产品种类未按规定期限报告在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局广东监管局的公开处罚。

平安证券股份有限公司因债券发行定价过程中，存在违反公平竞争等违规行为在本报告编制

前一年内受到中国证券监督管理委员会出具警示函的处分；因公司运作、治理违规、未依法履行职责等行为在本报告编制前一年内受到上海证券交易所出具警示函的处分。

中国农业银行股份有限公司因流动资金贷款被用于固定资产投资等行为在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚。

中国银行股份有限公司因部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求等原因在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚；因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查在本报告编制前一年内受到国家外汇管理局北京市分局的公开处罚；因代理销售保险夸大保险责任、承诺收益等欺骗投保人在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局北京监管局的公开处罚；因违反账户管理规定等原因在本报告编制前一年内受到中国人民银行的公开处罚与公开批评。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外，其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	32,892.06
2	应收证券清算款	405,730.81
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,100.08
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	442,722.95

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	391,499.48	0.23
2	123177	测绘转债	252,613.48	0.15
3	123150	九强转债	204,084.77	0.12
4	113060	浙 22 转债	199,251.01	0.12
5	123212	立中转债	184,845.80	0.11
6	113043	财通转债	180,605.93	0.10
7	127090	兴瑞转债	178,188.76	0.10

8	111018	华康转债	176,526.16	0.10
9	127020	中金转债	175,665.60	0.10
10	123202	祥源转债	175,378.38	0.10
11	110067	华安转债	175,287.45	0.10
12	110090	爱迪转债	174,857.05	0.10
13	123200	海泰转债	173,523.95	0.10
14	123191	智尚转债	173,407.92	0.10
15	110094	众和转债	173,230.05	0.10
16	123147	中辰转债	173,057.05	0.10
17	123187	超达转债	172,686.10	0.10
18	123224	宇邦转债	172,368.79	0.10
19	123226	中富转债	172,165.66	0.10
20	111015	东亚转债	171,442.46	0.10
21	110089	兴发转债	170,816.38	0.10
22	118039	煜邦转债	170,332.60	0.10
23	127051	博杰转债	170,182.75	0.10
24	127103	东南转债	169,819.22	0.10
25	128132	交建转债	169,523.51	0.10
26	118041	星球转债	169,506.53	0.10
27	128144	利民转债	169,323.63	0.10
28	127100	神码转债	169,129.44	0.10
29	111016	神通转债	168,884.30	0.10
30	123115	捷捷转债	144,790.26	0.08
31	123182	广联转债	143,695.04	0.08
32	110068	龙净转债	134,463.53	0.08
33	123201	纽泰转债	114,787.29	0.07
34	110062	烽火转债	113,065.40	0.07
35	113682	益丰转债	109,433.35	0.06
36	113637	华翔转债	99,984.22	0.06
37	110073	国投转债	89,869.14	0.05
38	123117	健帆转债	89,234.35	0.05
39	118025	奕瑞转债	89,056.57	0.05
40	127066	科利转债	88,397.04	0.05
41	113049	长汽转债	87,990.35	0.05
42	127078	优彩转债	86,242.15	0.05
43	113579	健友转债	83,864.69	0.05
44	127059	永东转 2	82,828.60	0.05
45	111014	李子转债	70,429.56	0.04
46	127095	广泰转债	66,241.27	0.04
47	123194	百洋转债	63,093.15	0.04
48	127086	恒邦转债	59,673.66	0.03
49	123231	信测转债	58,456.45	0.03

50	113638	台 21 转债	56,327.47	0.03
51	113659	莱克转债	45,635.36	0.03
52	123176	精测转 2	37,796.02	0.02
53	127045	牧原转债	34,701.30	0.02
54	118038	金宏转债	34,587.99	0.02
55	128066	亚泰转债	33,638.42	0.02
56	110082	宏发转债	33,273.25	0.02
57	123109	昌红转债	33,147.49	0.02
58	127046	百润转债	32,767.97	0.02
59	127015	希望转债	32,400.11	0.02
60	113661	福 22 转债	32,056.74	0.02
61	113633	科沃转债	31,721.55	0.02
62	111010	立昂转债	31,293.53	0.02
63	110085	通 22 转债	30,893.40	0.02
64	128105	长集转债	20,708.08	0.01
65	113059	福莱转债	20,542.74	0.01
66	123039	开润转债	13,979.58	0.01
67	127083	山路转债	12,725.69	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C
报告期期初基金份额总额	11,686,955.88	159,813,343.05
报告期期间基金总申购份额	254,144.52	226,024.13
减：报告期期间基金总赎回份额	1,024,208.02	12,804,329.33
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	10,916,892.38	147,235,037.85

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

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240701 - 20240930	59,787,537.02	0.00	0.00	59,787,537.02	37.80
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。</p>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康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》；
- (五) 《泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《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 10 月 24 日