

泰康恒泰回报灵活配置混合型  
证券投资基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
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	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 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	
报告期末基金份额总额	171,500,298.93 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	11,686,955.88 份	159,813,343.05 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	<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、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与权益类资产的投资，以增加基金收益。本基金在股票基本面研究的基础上，同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的上市公司股票进行投资。</p>
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		泰康基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	方圆
	联系电话	010-89620366	95559
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	fangy_20@kcomm.comban
客户服务电话		4001895522	95559
传真		010-89620100	021-62701216
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	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 3、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		金志刚	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)	
	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C
本期已实现收益	152,856.91	2,083,495.26
本期利润	213,167.32	2,903,934.77
加权平均基金份额本期利润	0.0175	0.0178
本期加权平均净值利润率	1.73%	1.68%
本期基金份额净值增长率	1.76%	1.71%
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	-246,323.13	2,929,954.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0211	0.0183
期末基金资产净值	11,979,484.19	170,506,549.24
期末基金份额净值	1.0250	1.0669
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	39.18%	44.87%

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	-0.03%	0.11%	-0.02%	0.10%	-0.01%	0.01%
过去三个月	1.11%	0.12%	0.90%	0.14%	0.21%	-0.02%
过去六个月	1.76%	0.14%	3.08%	0.17%	-1.32%	-0.03%
过去一年	0.91%	0.16%	2.43%	0.17%	-1.52%	-0.01%
过去三年	-4.67%	0.33%	3.37%	0.21%	-8.04%	0.12%
自基金合同生效起至今	39.18%	0.29%	31.42%	0.22%	7.76%	0.07%

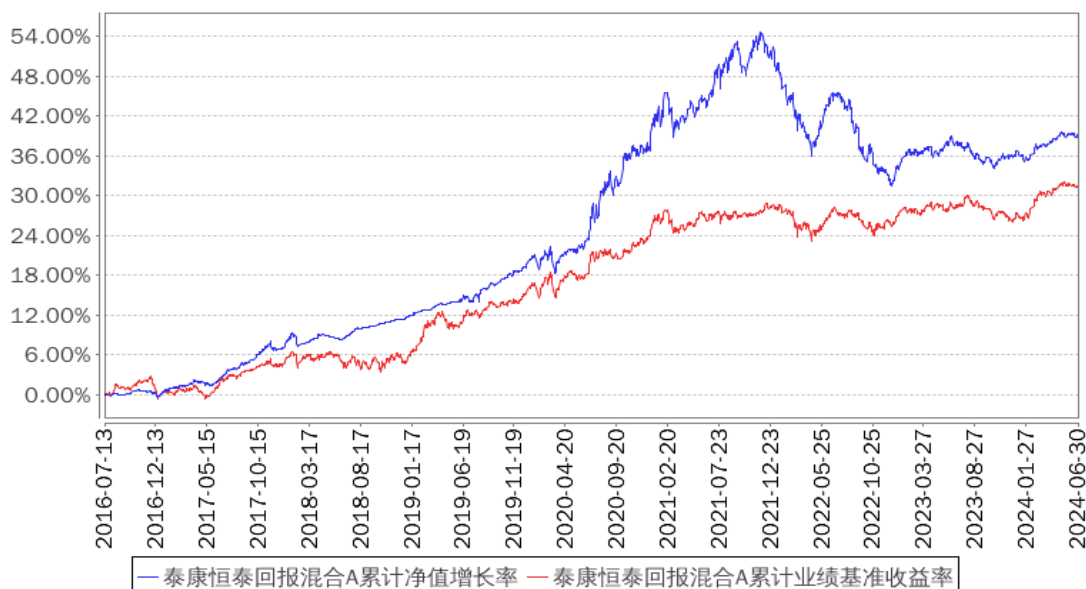
泰康恒泰回报混合 C

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	-0.03%	0.11%	-0.02%	0.10%	-0.01%	0.01%
过去三个月	1.09%	0.12%	0.90%	0.14%	0.19%	-0.02%
过去六个月	1.71%	0.14%	3.08%	0.17%	-1.37%	-0.03%
过去一年	0.81%	0.16%	2.43%	0.17%	-1.62%	-0.01%
过去三年	-4.93%	0.33%	3.37%	0.21%	-8.30%	0.12%
自基金合同生效起至今	44.87%	0.32%	31.42%	0.22%	13.45%	0.10%

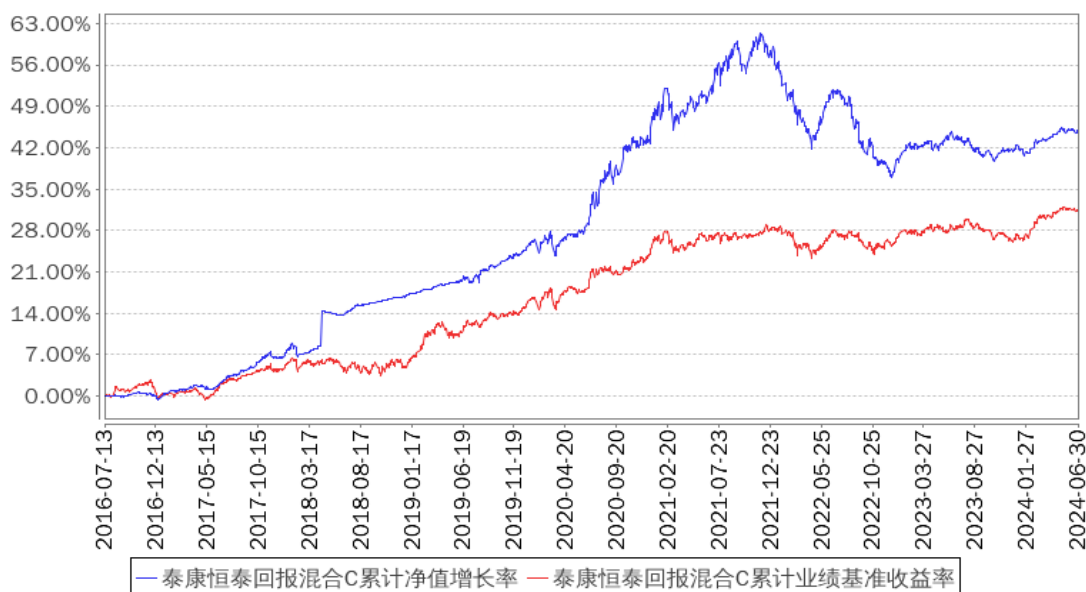


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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		
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。
金宏伟	本基金基金经理	2020 年 7 月 2 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。
朱婕	本基金基金经理助理	2020 年 5 月 13 日	2024 年 5 月 6 日	11 年	朱婕于 2015 年 4 月加入泰康资产，担任股票研究员。2018 年 4 月加入泰康公募，曾任中国国际金融有限公司分析师。2020 年 5 月 13 日至 2024 年 5 月 6 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助理。

注：1、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。

2、基金管理人已于 2024 年 7 月 6 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》，王凌力先生自 2024 年 7 月 4 日起担任本基金基金经理，金宏伟先生不再担任本基金基金经理。

#### 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 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、因地产形势变化的财富效应等在二季度都不太乐观。政策坚持了以中长期结构转型为主导的方向，制造业研发、生产、出口继续对经济形成托底。

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

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，进入上半年，经济增长趋弱，逆周期调节持续，信用政策持续宽松，货币政策从合理充裕到更加注重实效，财政政策持续，房地产虽有政策但未改变趋弱方向，消费春节回暖后期趋弱，国际环境变化较多，中美是有管控的竞争，市场大幅波动，先下后上再震荡。从大盘和板块上来看，上半年上证综指下跌 0.25%，沪深 300 上涨 0.89%，创业板指下跌 10.99%。板块间分化较大，其中，公用事业、银行等上涨较多，计算机、传媒和社服等下跌较多，大市值股

票明显优于小市值股票。

权益投资方面，在本期，基金在仓位上相机抉择，整体保持中偏低仓位，尤其在 1 月快速下跌阶段，保持极低仓位，有效控制了回撤；2 月后加仓，积极参与“春季躁动”，然后适当卖出高收益品种；4 月中下旬有加仓，5 月下旬降仓。在行业配置上，以公用事业、通信、银行、汽车、军工、电网设备、机械和低空经济方向等为主，适当配置其他优质个股。站在当下时点，科技发展、政策支持、行业景气和低估值高分红是市场重点关注的方向，本基金投资坚持“自下而上为主、自上而下为辅”的策略，寻找估值、增速和公司及行业前景相匹配的个股进行配置。

#### 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 1.0250 元,本报告期基金 A 份额净值增长率为 1.76%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.0669 元,本报告期基金 C 份额净值增长率为 1.71%；同期业绩比较基准增长率为 3.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

固收投资上，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。

展望下半年，宏观经济预计延续较弱走势，在年初 GDP 目标下，预计将有相关托底政策陆续推出，但经济基本面明显改善的概率不大。价格方面，由于需求较弱，预计 CPI、PPI 仍旧保持较低水平。流动性方面，海外美联储降息的概率在增加。整体来看，市场出现系统性上涨的概率不大，投资机会依旧集中在结构性板块和个股。从操作来看，长期而言，我们将持续聚焦基本面优质，具备强大经营壁垒的优秀企业，享受其业绩增长带来的长期收益；中短期操作来看，我们将坚持自上而下与自下而上相结合，重点加强中观行业研究和微观个股研究，寻找处于经营上行周期、估值合理的标的进行配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部）、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，泰康基金管理有限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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由泰康基金管理有限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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	304,677.88	214,819.51
结算备付金		965,661.23	732,349.53
存出保证金		49,870.47	92,985.84
交易性金融资产	6.4.7.2	196,894,311.70	262,948,476.90
其中：股票投资		17,557,566.00	23,074,295.26
基金投资		-	-
债券投资		179,336,745.70	239,874,181.64
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		2,503,718.71	4,594,171.80
应收股利		-	-
应收申购款		369.67	2,497.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		200,718,609.66	268,585,300.70
<b>负债和净资产</b>			
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		17,907,931.62	74,370,027.52
应付清算款		-	4,707,933.28
应付赎回款		28,280.35	424,652.83



应付管理人报酬		89,957.93	96,648.62
应付托管费		14,992.97	16,108.12
应付销售服务费		14,005.26	14,996.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,872.21	8,640.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	173,535.89	223,926.95
负债合计		18,232,576.23	79,862,934.00
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	171,500,298.93	180,418,016.45
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	10,985,734.50	8,304,350.25
净资产合计		182,486,033.43	188,722,366.70
负债和净资产总计		200,718,609.66	268,585,300.70

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 171,500,298.93 份，其中泰康恒泰回报混合 A 基金份额总额 11,686,955.88 份，基金份额净值 1.0250 元；泰康恒泰回报混合 C 基金份额总额 159,813,343.05 份，基金份额净值 1.0669 元。

## 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		4,339,489.38	15,635,780.98
1. 利息收入		20,140.82	88,771.02
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,212.42	28,406.12
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		928.40	60,364.90
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,437,847.67	10,340,525.99
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-280,284.50	4,469,184.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,447,346.09	5,579,853.49
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	270,786.08	291,487.77
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	880,749.92	5,203,377.94
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	750.97	3,106.03
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,222,387.29</b>	<b>1,938,299.81</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	551,163.23	1,016,401.46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	91,860.57	169,400.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	85,722.31	142,714.25
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		386,867.72	494,389.19
其中：卖出回购金融资产支出		386,867.72	494,389.19
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3,621.40	11,340.11
8. 其他费用	6.4.7.23	103,152.06	104,054.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,117,102.09</b>	<b>13,697,481.17</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,117,102.09</b>	<b>13,697,481.17</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>3,117,102.09</b>	<b>13,697,481.17</b>

### 6.3 净资产变动表

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：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	180,418,016.45	-	8,304,350.25	188,722,366.70

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	180,418,016.45	-	8,304,350.25	188,722,366.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,917,717.52	-	2,681,384.25	-6,236,333.27
(一)、综合收益总额	-	-	3,117,102.09	3,117,102.09
(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)	-8,917,717.52	-	-435,717.84	-9,353,435.36
其中：1. 基金申购款	670,469.35	-	30,196.10	700,665.45
2. 基金赎回款	-9,588,186.87	-	-465,913.94	-10,054,100.81
(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	171,500,298.93	-	10,985,734.50	182,486,033.43
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	355,361,823.88	-	3,297,842.32	358,659,666.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	355,361,823.88	-	3,297,842.32	358,659,666.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,490,369.00	-	13,036,724.24	-51,453,644.76
(一)、综合收益总额	-	-	13,697,481.17	13,697,481.17
(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)	-64,490,369.00	-	-660,756.93	-65,151,125.93
其中：1. 基金申购款	14,408,153.29	-	717,627.25	15,125,780.54
2. 基金赎回款	-78,898,522.29	-	-1,378,384.18	-80,276,906.47
(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	290,871,454.88	-	16,334,566.56	307,206,021.44

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>金志刚</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基金管理有限公司，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、存托凭证)、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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报

告》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操

作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	304,677.88
等于：本金	304,624.77
加：应计利息	53.11
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	304,677.88

## 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	16,985,578.21	-	17,557,566.00	571,987.79	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	39,920,581.62	368,141.37	41,196,618.97	907,895.98
	银行间市场	135,388,363.06	1,966,626.73	138,140,126.73	785,136.94
	合计	175,308,944.68	2,334,768.10	179,336,745.70	1,693,032.92
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	192,294,522.89	2,334,768.10	196,894,311.70	2,265,020.71	

## 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	84,972.77
其中：交易所市场	77,613.27
银行间市场	7,359.50
应付利息	-
预提费用	88,563.12
合计	173,535.89

#### 6.4.7.10 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 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	12,766,287.40	12,766,287.40
本期申购	210,126.13	210,126.13
本期赎回（以“-”号填列）	-1,289,457.65	-1,289,457.65
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	11,686,955.88	11,686,955.88

##### 泰康恒泰回报混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	167,651,729.05	167,651,729.05
本期申购	460,343.22	460,343.22
本期赎回（以“-”号填列）	-8,298,729.22	-8,298,729.22
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	159,813,343.05	159,813,343.05

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	-434,563.70	527,750.39	93,186.69
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-434,563.70	527,750.39	93,186.69
本期利润	152,856.91	60,310.41	213,167.32
本期基金份额交易产生的变动数	35,383.66	-49,209.36	-13,825.70
其中：基金申购款	-5,879.57	9,279.18	3,399.61
基金赎回款	41,263.23	-58,488.54	-17,225.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-246,323.13	538,851.44	292,528.31

## 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	899,389.22	7,311,774.34	8,211,163.56
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	899,389.22	7,311,774.34	8,211,163.56
本期利润	2,083,495.26	820,439.51	2,903,934.77
本期基金份额交易产生的变动数	-52,930.48	-368,961.66	-421,892.14
其中：基金申购款	4,449.66	22,346.83	26,796.49
基金赎回款	-57,380.14	-391,308.49	-448,688.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,929,954.00	7,763,252.19	10,693,206.19

## 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	1,606.95
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	17,003.94
其他	601.53
合计	19,212.42

## 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	-280,284.50
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	-280,284.50

#### 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	139,387,758.43
减：卖出股票成本总额	139,356,559.83
减：交易费用	311,483.10
买卖股票差价收入	-280,284.50

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,972,641.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	474,705.02
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	3,447,346.09

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	305,725,160.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	301,561,353.30
减：应计利息总额	3,678,421.00

减：交易费用	10,681.24
买卖债券差价收入	474,705.02

#### 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	270,786.08
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	270,786.08

#### 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	880,749.92
股票投资	-1,119.47
债券投资	881,869.39
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	880,749.92

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	638.82
基金转换费收入	112.15
合计	750.97

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中：申购费补差收取具体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	4,988.94
债券帐户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	103,152.06

#### 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	551,163.23	1,016,401.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	27,876.47	75,199.23
应支付基金管理人的净管理费	523,286.76	941,202.23

注：支付基金管理人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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	91,860.57	169,400.24

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C	合计
交通银行	-	84.92	84.92



泰康基金管理有限公司	-	78,639.59	78,639.59
合计	-	78,724.51	78,724.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康恒泰回报混合 A	泰康恒泰回报混合 C	合计
交通银行	-	83.92	83.92
泰康基金管理有限公司	-	131,200.38	131,200.38
合计	-	131,284.30	131,284.30

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，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$C \text{ 类基金份额日销售服务费} = C \text{ 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 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，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，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	304,677.88	1,606.95	240,708.17	3,558.70

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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 10,805,012.38 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
112405149	24 建设银行 CD149	2024 年 7 月 1 日	98.30	117,000	11,501,221.42
合计				117,000	11,501,221.42

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 7,102,919.24 元，于 2024 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理

人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人交通银行股份有限公司，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	11,139,484.26

合计	0.00	11,139,484.26
----	------	---------------

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	81,891,228.11	131,454,209.24
AAA 以下	16,195,716.35	28,961,836.55
未评级	20,749,438.25	20,426,026.23
合计	118,836,382.71	180,842,072.02

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	29,490,311.34	4,940,398.36
AAA 以下	0.00	4,957,912.52
未评级	0.00	0.00
合计	29,490,311.34	9,898,310.88

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2024 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有货币资金、结算备付金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 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	304,677.88	-	-	-	304,677.88
结算备付金	965,661.23	-	-	-	965,661.23
存出保证金	49,870.47	-	-	-	49,870.47
交易性金融资产	81,958,073.62	43,729,305.81	53,649,366.27	17,557,566.00	196,894,311.70
应收申购款	-	-	-	369.67	369.67
应收清算款	-	-	-	2,503,718.71	2,503,718.71
资产总计	83,278,283.20	43,729,305.81	53,649,366.27	20,061,654.38	200,718,609.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	28,280.35	28,280.35
应付管理人报酬	-	-	-	89,957.93	89,957.93
应付托管费	-	-	-	14,992.97	14,992.97
卖出回购金融资产款	17,907,931.62	-	-	-	17,907,931.62
应付销售服务费	-	-	-	14,005.26	14,005.26
应交税费	-	-	-	3,872.21	3,872.21
其他负债	-	-	-	173,535.89	173,535.89
负债总计	17,907,931.62	-	-	324,644.61	18,232,576.23
利率敏感度缺口	65,370,351.58	43,729,305.81	53,649,366.27	19,737,009.77	182,486,033.43
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	214,819.51	-	-	-	214,819.51
结算备付金	732,349.53	-	-	-	732,349.53
存出保证金	92,985.84	-	-	-	92,985.84
交易性金融资产	110,781,402.00	34,699,457.05	94,393,322.59	23,074,295.26	262,948,476.90
应收申购款	-	-	-	2,497.12	2,497.12
应收清算款	-	-	-	4,594,171.80	4,594,171.80
资产总计	111,821,556.88	34,699,457.05	94,393,322.59	27,670,964.18	268,585,300.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	424,652.83	424,652.83
应付管理人报酬	-	-	-	96,648.62	96,648.62
应付托管费	-	-	-	16,108.12	16,108.12
应付清算款	-	-	-	4,707,933.28	4,707,933.28
卖出回购金融资产款	74,370,027.52	-	-	-	74,370,027.52
应付销售服务费	-	-	-	14,996.30	14,996.30

应交税费	-	-	-	8,640.38	8,640.38
其他负债	-	-	-	223,926.95	223,926.95
负债总计	74,370,027.52	-	-	5,492,906.48	79,862,934.00
利率敏感度缺口	37,451,529.36	34,699,457.05	94,393,322.59	22,178,057.70	188,722,366.70

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%	-840,103.43	-1,066,951.58	
	市场利率下调 0.25%	853,849.89	1,078,976.57	

#### 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 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	17,557,566.00	9.62	23,074,295.26	12.23
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	17,557,566.00	9.62	23,074,295.26	12.23

#### 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%	632,538.49	834,692.47
业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-632,538.49	-834,692.47	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	26,813,041.41	34,349,005.95
第二层次	170,081,270.29	228,599,470.95
第三层次	-	-
合计	196,894,311.70	262,948,476.90

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	17,557,566.00	8.75
	其中：股票	17,557,566.00	8.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	179,336,745.70	89.35
	其中：债券	179,336,745.70	89.35
	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	1,270,339.11	0.63
8	其他各项资产	2,553,958.85	1.27
9	合计	200,718,609.66	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	-	-
C	制造业	7,998,895.00	4.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,545,932.00	1.40
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,590,190.00	2.52
J	金融业	1,083,823.00	0.59
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	1,338,726.00	0.73

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	17,557,566.00	9.62

### 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	600941	中国移动	27,200	2,924,000.00	1.60
2	601989	中国重工	326,900	1,611,617.00	0.88
3	002353	杰瑞股份	41,300	1,448,804.00	0.79
4	600886	国投电力	76,000	1,386,240.00	0.76
5	603338	浙江鼎力	22,400	1,353,408.00	0.74
6	300416	苏试试验	104,100	1,338,726.00	0.73
7	688378	奥来德	52,900	1,241,034.00	0.68
8	600900	长江电力	40,100	1,159,692.00	0.64
9	601728	中国电信	183,500	1,128,525.00	0.62
10	600036	招商银行	31,700	1,083,823.00	0.59
11	600760	中航沈飞	21,100	846,110.00	0.46
12	300298	三诺生物	23,000	582,820.00	0.32
13	002517	恺英网络	56,300	537,665.00	0.29
14	300750	宁德时代	2,600	468,078.00	0.26
15	002270	华明装备	20,100	447,024.00	0.24

注：对于同时在 A+H 股上市股票，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	002594	比亚迪	4,973,186.00	2.64
2	000338	潍柴动力	4,482,491.00	2.38
3	300396	迪瑞医疗	4,473,474.00	2.37
4	301091	深城交	4,020,161.00	2.13
5	000600	建投能源	3,730,962.00	1.98
6	688631	莱斯信息	3,613,250.73	1.91

7	002294	信立泰	3,597,545.00	1.91
8	002142	宁波银行	3,336,878.60	1.77
9	601688	华泰证券	3,325,863.00	1.76
10	688122	西部超导	3,308,800.30	1.75
11	600941	中国移动	3,256,326.00	1.73
12	688789	宏华数科	2,914,802.03	1.54
13	603338	浙江鼎力	2,904,781.00	1.54
14	300129	泰胜风能	2,799,645.00	1.48
15	603191	望变电气	2,791,209.00	1.48
16	600309	万华化学	2,773,740.00	1.47
17	300416	苏试试验	2,667,273.00	1.41
18	600109	国金证券	2,224,513.00	1.18
19	600886	国投电力	2,218,312.00	1.18
20	600900	长江电力	2,206,675.00	1.17

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	000338	潍柴动力	5,513,295.00	2.92
2	002594	比亚迪	5,203,433.00	2.76
3	300396	迪瑞医疗	4,320,028.00	2.29
4	301091	深城交	4,152,606.00	2.20
5	688631	莱斯信息	4,019,638.56	2.13
6	002270	华明装备	3,636,842.00	1.93
7	000600	建投能源	3,569,562.00	1.89
8	002142	宁波银行	3,530,512.00	1.87
9	002294	信立泰	3,468,736.00	1.84
10	688122	西部超导	3,366,294.69	1.78
11	601688	华泰证券	3,339,433.00	1.77
12	688789	宏华数科	3,224,997.65	1.71
13	603191	望变电气	2,975,449.00	1.58
14	600309	万华化学	2,860,984.00	1.52
15	300129	泰胜风能	2,637,256.00	1.40
16	600886	国投电力	2,619,049.00	1.39
17	002063	远光软件	2,408,908.00	1.28
18	600050	中国联通	2,337,929.00	1.24
19	600109	国金证券	2,254,308.00	1.19
20	002090	金智科技	2,006,376.00	1.06

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。

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	133,840,950.04
卖出股票收入（成交）总额	139,387,758.43

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	82,682,182.87	45.31
	其中：政策性金融债	31,010,051.65	16.99
4	企业债券	20,886,635.07	11.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	36,245,401.56	19.86
7	可转债（可交换债）	10,032,214.86	5.50
8	同业存单	29,490,311.34	16.16
9	其他	-	-
10	合计	179,336,745.70	98.27

#### 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	112405149	24 建设银行 CD149	300,000	29,490,311.34	16.16
2	148253	23 广发 Y2	100,000	10,689,397.26	5.86
3	230420	23 农发 20	100,000	10,626,565.57	5.82
4	2028034	20 浦发银行 二级 03	100,000	10,600,800.00	5.81
5	2028044	20 广发银行 二级 01	100,000	10,570,406.56	5.79

## 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

广发银行股份有限公司信用卡中心因治理违规在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局广东监管局的公开处罚。

广发证券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中国证券监督管理委员会的公开处罚、公开批评和责令改正；因未依法履行其他职责在本报告编制前一年内收到上海证券交易所的监管警示。

中国东方资产管理股份有限公司因违规提供担保及财务资助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；因未依法履行其他职责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。

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

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。

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	49,870.47
2	应收清算款	2,503,718.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	369.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,553,958.85

### 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	113052	兴业转债	1,166,586.50	0.64
2	113050	南银转债	890,425.78	0.49
3	132026	G 三峡 EB2	776,739.45	0.43
4	111017	蓝天转债	337,034.26	0.18
5	123182	广联转债	282,829.36	0.15
6	111010	立昂转债	267,823.72	0.15
7	110073	国投转债	267,351.99	0.15
8	113066	平煤转债	247,638.28	0.14
9	113654	永 02 转债	228,435.63	0.13
10	113024	核建转债	222,923.60	0.12
11	123022	长信转债	220,425.83	0.12
12	123035	利德转债	218,506.56	0.12
13	113530	大丰转债	198,668.22	0.11
14	127051	博杰转债	196,569.62	0.11
15	127020	中金转债	173,445.63	0.10
16	110068	龙净转债	168,954.12	0.09
17	127035	濮耐转债	167,962.56	0.09
18	123169	正海转债	162,154.32	0.09
19	123115	捷捷转债	150,600.44	0.08
20	113051	节能转债	150,472.82	0.08
21	113598	法兰转债	148,321.64	0.08
22	113049	长汽转债	143,112.73	0.08
23	123219	宇瞳转债	128,747.50	0.07



24	110094	众和转债	123,262.55	0.07
25	110081	闻泰转债	115,949.63	0.06
26	127090	兴瑞转债	112,284.83	0.06
27	127086	恒邦转债	111,767.99	0.06
28	127056	中特转债	111,525.32	0.06
29	127075	百川转 2	110,159.41	0.06
30	118043	福立转债	109,059.46	0.06
31	123231	信测转债	107,480.32	0.06
32	118027	宏图转债	104,156.20	0.06
33	110062	烽火转债	103,402.15	0.06
34	113675	新 23 转债	102,021.08	0.06
35	113043	财通转债	100,039.44	0.05
36	110067	华安转债	99,823.44	0.05
37	128066	亚泰转债	99,018.90	0.05
38	123025	精测转债	98,139.65	0.05
39	123193	海能转债	94,919.92	0.05
40	110060	天路转债	93,758.77	0.05
41	110089	兴发转债	91,027.02	0.05
42	110083	苏租转债	76,322.29	0.04
43	128144	利民转债	70,817.33	0.04
44	123076	强力转债	59,020.08	0.03
45	113639	华正转债	57,730.20	0.03
46	113615	金诚转债	56,707.91	0.03
47	113060	浙 22 转债	56,296.06	0.03
48	118038	金宏转债	55,764.74	0.03
49	111008	沿浦转债	53,598.12	0.03
50	123197	光力转债	52,258.96	0.03
51	113519	长久转债	51,639.53	0.03
52	111004	明新转债	49,944.00	0.03
53	113669	景 23 转债	47,637.52	0.03
54	118003	华兴转债	40,239.88	0.02
55	123174	精锻转债	22,574.80	0.01
56	127079	华亚转债	20,150.83	0.01
57	127095	广泰转债	12,975.22	0.01

### 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	694	16,839.99	0.00	0.00	11,686,955.88	100.00
泰康恒泰回报混合 C	1,435	111,368.18	101,334,966.25	63.41	58,478,376.80	36.59
合计	2,081	82,412.45	101,334,966.25	59.09	70,165,332.68	40.91

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	55,438.43	0.4744
	泰康恒泰回报混合 C	92,543.38	0.0579
	合计	147,981.81	0.0863

### 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	泰康恒泰回报混合 A	0~10
	泰康恒泰回报混合 C	0~10
	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	12,766,287.40	167,651,729.05
本报告期基金总申 购份额	210,126.13	460,343.22
减：本报告期基金 总赎回份额	1,289,457.65	8,298,729.22
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	11,686,955.88	159,813,343.05

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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 (%)	
民生证券	2	273,220,218.47	100.00	224,267.25	100.00	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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(%)
民生证券	118,369,291.47	100.00	570,780,000.00	100.00	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

## 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	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金 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	《中国证券报》；中国	2024 年 03 月 25 日

	下部分开放式基金在深圳前海微众银行股份有限公司最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告	证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
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》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 03 月 28 日
5	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金 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	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金 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	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金（泰康恒泰回报混合 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	泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金（泰康恒泰回报混合 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	59,787,537.02	0.00	0.00	59,787,537.02	34.86
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》；
- (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》。

### 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