

泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
送出日期：2018年8月27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。本年度报告正文三分之二以上独立董事签字同意，并有董事签字。
基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“农发行”）根据本基金合同规定，于2018年6月24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预示其未来业绩表现，投资有风险，投资者在进行投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本半年度报告摘要摘自半年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告期为2018年1月1日起至2018年6月30日止。
§2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	泰康沪港深价值优选混合
基金代码	008680
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月29日
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期内基金基金经理	122,721,446,033
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在内地与香港证券市场优选具有投资价值或成长潜力的公司进行投资，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。
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，自上而下选择成长性、自下而上精选个股。在宏观经济政策、行业景气度、公司基本面、估值水平、流动性等因素的基础上，结合定量分析，进行深入的个股研究，力争实现基金资产的长期增值。本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下选择成长性、自下而上精选个股。在宏观经济政策、行业景气度、公司基本面、估值水平、流动性等因素的基础上，结合定量分析，进行深入的个股研究，力争实现基金资产的长期增值。本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下选择成长性、自下而上精选个股。在宏观经济政策、行业景气度、公司基本面、估值水平、流动性等因素的基础上，结合定量分析，进行深入的个股研究，力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	恒生指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
住所	北京市西城区金融大街19号泰康大厦15层	北京市东城区建国门内大街29号
办公地址	北京市西城区金融大街19号泰康大厦15层	北京市东城区建国门内大街29号
法定代表人	陈健华	贺腾
信息披露负责人	电话：010-56753063 010-56753063	010-66000009
电子邮箱	chenjw@taikangamc.com.cn	tgxsp@abchina.com
客户服务电话	4008906222	95599
传真	010-56718778	010-66121818

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的互联网网址	www.taikangamc.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	金额单位：人民币元
3.1.1 期间数据和指标	报告期末(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	1,562,340.73
本期利润	-9,406,900.76
加权平均基金份额本期利润	-0.0706
本期基金份额净值增长率	-6.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1341
期末基金资产净值	139,174,281.70
期末基金份额净值	1.1341

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）扣除相关费用后的净额，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未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

阶段	自前次资产净值增长率①	业绩比较基准收益率②	超额收益③	①-③	②-④
过去一个月	-4.96%	1.52%	-4.04%	-0.91%	-0.62%
过去三个月	-3.09%	1.23%	-3.10%	-0.88%	-0.49%
过去六个月	-6.23%	1.26%	-2.69%	0.96%	-3.54%
过去一年	7.30%	1.13%	0.38%	0.80%	-2.09%
自基金合同生效以来	13.41%	0.94%	24.42%	0.71%	-11.01%

注：(1)本基金基金合同于2016年12月29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 基金管理人及基金情况

4.1.1 基金管理人及基金的基本情况

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、金融地产投资等，所提供的服务和产品包括保险保障基金、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理业务、资产管理业务、养老业务等。2017年12月，公募基金业务，基本养老金投资管理业务。截至2017年12月31日，泰康资产管理资产规模超过12000亿元。除管理养老金委托资产外，泰康资产三大业务总规模超6000亿元，另类投资资产规模超33000亿元，退休基金管理规模超2000亿元，是中国市场最大的退休基金管理人之一。

2016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，成为首家获得业务资格的保险资产管理公司。截至2016年6月30日，公司管理公募基金业务，基本养老金投资管理业务，资产管理业务，养老业务等。2017年12月，公募基金业务，基本养老金投资管理业务。截至2017年12月31日，泰康资产管理资产规模超过12000亿元。除管理养老金委托资产外，泰康资产三大业务总规模超6000亿元，另类投资资产规模超33000亿元，退休基金管理规模超2000亿元，是中国市场最大的退休基金管理人之一。

2016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，成为首家获得业务资格的保险资产管理公司。截至2016年6月30日，公司管理公募基金业务，基本养老金投资管理业务，资产管理业务，养老业务等。2017年12月，公募基金业务，基本养老金投资管理业务。截至2017年12月31日，泰康资产管理资产规模超过12000亿元。除管理养老金委托资产外，泰康资产三大业务总规模超6000亿元，另类投资资产规模超33000亿元，退休基金管理规模超2000亿元，是中国市场最大的退休基金管理人之一。

2016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，成为首家获得业务资格的保险资产管理公司。截至2016年6月30日，公司管理公募基金业务，基本养老金投资管理业务，资产管理业务，养老业务等。2017年12月，公募基金业务，基本养老金投资管理业务。截至2017年12月31日，泰康资产管理资产规模超过12000亿元。除管理养老金委托资产外，泰康资产三大业务总规模超6000亿元，另类投资资产规模超33000亿元，退休基金管理规模超2000亿元，是中国市场最大的退休基金管理人之一。

4.1.2 基金业绩

注：1.本基金基金合同于2016年12月29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。

§5 投资组合报告

5.1 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.2 资产配置情况

截至2018年6月30日，基金资产配置情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.3 行业配置情况

截至2018年6月30日，基金行业配置情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.4 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.5 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.6 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.7 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.8 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.9 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.10 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.11 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.12 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.13 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.14 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.15 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.16 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.17 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.18 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.19 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.20 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.21 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.22 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.23 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.24 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.25 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.26 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.27 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.28 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.29 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.30 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.31 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.32 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.33 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.34 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.35 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.36 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.37 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.38 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.39 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.40 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.41 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.42 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.43 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.44 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。

5.45 基金资产组合情况

截至2018年6月30日，基金资产组合情况如下：

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.1341元，基金份额总额122,721,446,033份。