

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司  
基金托管人：招商银行股份有限公司  
报告送达日期：2019年1月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监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。

基金托管人对本基金的财务状况、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核没有不存在虚假记载、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。投资人风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读基金的招募说明书及更新。

本报告期为2018年10月1日至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金

基金简称 泰康兴泰回报

基金类型 混合型

运作方式 封闭式

上市地 上海证券交易所

基金合同生效日 2017年6月15日

报告期末基金总资产 215,826,264.30元

投资目标 本基金通过合理的资产配置，在合理控制风险的前提下，力争实现超越业绩基准的投资回报。

投资策略 本基金将充分考虑宏观经济、政策、市场环境、行业景气度、公司基本面等多方面的因素，综合评估不同资产类别的预期收益和风险，通过合理的资产配置，在合理控制风险的前提下，力争实现超越业绩基准的投资回报。

业绩比较基准 65%×沪深300指数+35%×恒生指数

净值增长率波动率 10.61%

风险收益特征 本基金为混合型基金，预期收益和风险水平高于股票型基金，低于债券型基金与货币市场基金。

基金管理人 泰康资产管理有限公司

基金托管人 招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位：人民币元

报告期：2018年10月1日 - 2018年12月31日(1)

1.本期已实现收益 2,046,236.20

2.本期利润 -1,478,468.89

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0077

4.期末基金份额净值 227,481,636.76

5.期末可供分配基金份额总额 10,634,500.00

(2) 本期所取得的基金利润不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列示数据。

3.2 资产净值表现

3.2.1 本报告期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 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 收益率差值④

过去三个月 -0.05% 0.26% -0.05% 0.25%

-0.04% 0.04%

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

单位：人民币元

报告期：2018年10月1日 - 2018年12月31日(1)

1.本期已实现收益 2,046,236.20

2.本期利润 -1,478,468.89

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0077

4.期末基金份额净值 227,481,636.76

5.期末可供分配基金份额总额 10,634,500.00

6.期末持有的现金及现金等价物余额 11,967,630.71元

7.期末持有的存出保证金 11,967,630.71元

8.期末持有的其他资产 0.00元

9.期末持有的待摊费用 0.00元

10.期末持有的其他资产 0.00元

11.期末持有的待摊费用 0.00元

12.期末持有的其他资产 0.00元

13.期末持有的待摊费用 0.00元

14.期末持有的其他资产 0.00元

15.期末持有的待摊费用 0.00元

16.期末持有的其他资产 0.00元

17.期末持有的待摊费用 0.00元

18.期末持有的其他资产 0.00元

19.期末持有的待摊费用 0.00元

20.期末持有的其他资产 0.00元

21.期末持有的待摊费用 0.00元

22.期末持有的其他资产 0.00元

23.期末持有的待摊费用 0.00元

24.期末持有的其他资产 0.00元

25.期末持有的待摊费用 0.00元

26.期末持有的其他资产 0.00元

27.期末持有的待摊费用 0.00元

28.期末持有的其他资产 0.00元

29.期末持有的待摊费用 0.00元

30.期末持有的其他资产 0.00元

31.期末持有的待摊费用 0.00元

32.期末持有的其他资产 0.00元

33.期末持有的待摊费用 0.00元

34.期末持有的其他资产 0.00元

35.期末持有的待摊费用 0.00元

36.期末持有的其他资产 0.00元

37.期末持有的待摊费用 0.00元

38.期末持有的其他资产 0.00元

39.期末持有的待摊费用 0.00元

40.期末持有的其他资产 0.00元

41.期末持有的待摊费用 0.00元

42.期末持有的其他资产 0.00元

43.期末持有的待摊费用 0.00元

44.期末持有的其他资产 0.00元

45.期末持有的待摊费用 0.00元

46.期末持有的其他资产 0.00元

47.期末持有的待摊费用 0.00元

48.期末持有的其他资产 0.00元

49.期末持有的待摊费用 0.00元

50.期末持有的其他资产 0.00元

51.期末持有的待摊费用 0.00元

52.期末持有的其他资产 0.00元

53.期末持有的待摊费用 0.00元

54.期末持有的其他资产 0.00元

55.期末持有的待摊费用 0.00元

56.期末持有的其他资产 0.00元

57.期末持有的待摊费用 0.00元

58.期末持有的其他资产 0.00元

59.期末持有的待摊费用 0.00元

60.期末持有的其他资产 0.00元

61.期末持有的待摊费用 0.00元

62.期末持有的其他资产 0.00元

63.期末持有的待摊费用 0.00元

64.期末持有的其他资产 0.00元

65.期末持有的待摊费用 0.00元

66.期末持有的其他资产 0.00元

67.期末持有的待摊费用 0.00元

68.期末持有的其他资产 0.00元

69.期末持有的待摊费用 0.00元

70.期末持有的其他资产 0.00元

71.期末持有的待摊费用 0.00元

72.期末持有的其他资产 0.00元

73.期末持有的待摊费用 0.00元

74.期末持有的其他资产 0.00元

75.期末持有的待摊费用 0.00元

76.期末持有的其他资产 0.00元

77.期末持有的待摊费用 0.00元

78.期末持有的其他资产 0.00元

79.期末持有的待摊费用 0.00元

80.期末持有的其他资产 0.00元

81.期末持有的待摊费用 0.00元

82.期末持有的其他资产 0.00元

83.期末持有的待摊费用 0.00元

84.期末持有的其他资产 0.00元

85.期末持有的待摊费用 0.00元

86.期末持有的其他资产 0.00元

87.期末持有的待摊费用 0.00元

88.期末持有的其他资产 0.00元

89.期末持有的待摊费用 0.00元

90.期末持有的其他资产 0.00元

91.期末持有的待摊费用 0.00元

92.期末持有的其他资产 0.00元

93.期末持有的待摊费用 0.00元

94.期末持有的其他资产 0.00元

95.期末持有的待摊费用 0.00元

96.期末持有的其他资产 0.00元

97.期末持有的待摊费用 0.00元

98.期末持有的其他资产 0.00元

99.期末持有的待摊费用 0.00元

100.期末持有的其他资产 0.00元

101.期末持有的待摊费用 0.00元

102.期末持有的其他资产 0.00元

103.期末持有的待摊费用 0.00元

104.期末持有的其他资产 0.00元

105.期末持有的待摊费用 0.00元

106.期末持有的其他资产 0.00元

107.期末持有的待摊费用 0.00元

108.期末持有的其他资产 0.00元

109.期末持有的待摊费用 0.00元

110.期末持有的其他资产 0.00元

111.期末持有的待摊费用 0.00元

112.期末持有的其他资产 0.00元

113.期末持有的待摊费用 0.00元

114.期末持有的其他资产 0.00元

115.期末持有的待摊费用 0.00元

116.期末持有的其他资产 0.00元

117.期末持有的待摊费用 0.00元

118.期末持有的其他资产 0.00元