

泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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
报告送出日期：2019年7月16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。
本基金托管人中行国际银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2019年7月15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。
本报告期本基金份额总额：140,604,312.04份
投资目标
本基金将在严格控制风险的前提下追求资产的流动性，在合理配置大类资产和精选的行业的基础上，通过合理的投资操作，实现资本增值。
本基金将充分地利用在各类资产上配置的资产比例，通过合理配置大类资产和精选的行业，力争超越业绩比较基准的1%。同时在合理的范围内，通过精选个股，来获得超额收益。
固定收益类投资比例：本基金通过投资债券、货币市场工具、权证、股票、基金、期货、期权、资产支持证券、衍生品等金融工具，以获取稳定的收益。
投资策略
本基金在充分地利用在各类资产上配置的资产比例，通过合理配置大类资产和精选的行业的基础上，通过合理的投资操作，实现资本增值。
投资范围
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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、货币市场工具、权证、股票、基金、期货、期权、资产支持证券、衍生品等金融工具。
业债比较基准
20%×沪深300指数收益+70%×中债综合全价(总值)指数
风险收益特征
本基金属混合型基金，其预期收益及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
泰康资产管理有限责任公司
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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1本期已实现收益	4,673,022.20
2本期利润	2,446,656.60
3加权平均基金份额本期利润	0.0167
4期末基金份额净值	169,390.22443
5期末基金资产净值	13,406

注：本基金合同于2017年5月10日生效。
2.按照本基金的基金合同规定，基金管理人应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有关约定。

3.1 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1本期已实现收益	4,673,022.20
2本期利润	2,446,656.60
3加权平均基金份额本期利润	0.0167
4期末基金份额净值	169,390.22443
5期末基金资产净值	13,406

注：本基金合同于2017年5月10日生效。

4.2 按照基金的基金合同规定，基金管理人应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有关规定。

没有达到规定的投资比例，基金管理人将予以纠正。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况的说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指引》及公司内部公平交易制度，对旗下所有投资组合严格执行公平交易制度，确保旗下不同投资组合在交易上的公平性。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现异常交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金合同于2017年5月10日生效。

4.4.2 基金管理人对旗下所有投资组合每日交易行为的交易记录进行监控，对发现的不同投资组合同日反向交易、同日反向交易且成交金额较大、可能显著影响市场价格的交易行为，基金管理人将予以纠正。

4.4.3 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.4 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.5 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.6 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.7 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.8 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.9 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.10 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.11 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.12 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.13 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.14 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.15 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.16 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.17 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.18 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.19 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.20 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.21 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.22 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.23 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.24 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.25 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.26 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.27 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.28 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.29 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.30 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.31 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.32 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.33 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.34 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.35 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.36 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.37 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.38 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.39 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.40 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.41 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.42 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.43 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.44 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.45 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.46 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.47 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.48 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.49 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.50 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.51 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.52 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.53 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.54 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.55 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.56 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.57 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.58 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.59 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.60 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.61 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.62 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.63 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.64 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.65 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。

4.4.66 基金管理人对旗下所有投资组合同日反向交易且成交金额较大的交易行为的定价公允性进行复核，对发现存在不公平交易情形的，基金管理人将予以纠正。