

信息披露 Disclosure

泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

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
报告日期:2019年8月24日

1.1 重要提示
基金管理人承诺:本基金信息披露不存在虚假记载、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。

1.2 基金概况
基金名称:泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金
基金代码:004340

2.1 基金基本情况
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

2.2 基金业绩说明
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*40%+中证500指数收益率*30%+中证800指数收益率*30%

2.3 基金投资策略
本基金投资策略:本基金为混合型证券投资基金,主要投资于具有良好成长性的股票、债券、货币市场工具等。

2.4 基金风险提示
本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应认真阅读基金合同、基金招募说明书等基金文件。

2.5 基金管理人承诺
基金管理人承诺:本基金信息披露不存在虚假记载、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。

2.6 基金托管人承诺
基金托管人承诺:本基金信息披露不存在虚假记载、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。

2.7 会计师事务所
德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金2019年半年度报告出具了标准无保留意见的审计报告。

2.8 其他重要事项
本基金于2019年1月1日起正式建仓,截至2019年6月30日,本基金资产净值1,140,621,314.00元,基金份额持有人户数1,140,621户。

2.9 基金管理人联系方式
基金管理人:泰康资产管理有限责任公司
地址:北京市西城区金融大街19号泰康大厦

2.10 基金管理人网址
基金管理人网址:www.taikangamc.com.cn

2.11 基金管理人客服电话
基金管理人客服电话:4001888282

2.12 基金管理人销售机构
基金管理人销售机构:招商银行股份有限公司

2.13 基金管理人直销机构
基金管理人直销机构:泰康资产管理有限责任公司

2.14 基金管理人其他联系方式
基金管理人其他联系方式:基金管理人官方网站

2.15 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.16 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.17 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.18 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.19 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.20 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.21 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.22 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.23 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.24 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.25 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.26 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.27 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.28 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.29 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.30 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.31 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.32 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.33 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.34 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.35 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.36 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.37 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.38 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.39 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.40 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.41 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.42 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.43 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.44 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.45 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.46 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.47 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.48 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.49 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.50 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.51 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.52 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.53 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.54 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.55 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.56 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.57 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

2.58 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告披露的日期。

4.1 基金管理人承诺:本基金信息披露不存在虚假记载、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。

4.2 基金托管人承诺:本基金信息披露不存在虚假记载、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。

4.3 会计师事务所
德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金2019年半年度报告出具了标准无保留意见的审计报告。

4.4 其他重要事项
本基金于2019年1月1日起正式建仓,截至2019年6月30日,本基金资产净值1,140,621,314.00元,基金份额持有人户数1,140,621户。

4.5 基金管理人联系方式
基金管理人:泰康资产管理有限责任公司
地址:北京市西城区金融大街19号泰康大厦

4.6 基金管理人网址
基金管理人网址:www.taikangamc.com.cn

4.7 基金管理人客服电话
基金管理人客服电话:4001888282

4.8 基金管理人销售机构
基金管理人销售机构:招商银行股份有限公司

4.9 基金管理人直销机构
基金管理人直销机构:泰康资产管理有限责任公司

4.10 基金管理人其他联系方式
基金管理人其他联系方式:基金管理人官方网站

4.11 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.12 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.13 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.14 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.15 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.16 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.17 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.18 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.19 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.20 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.21 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.22 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.23 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.24 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.25 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.26 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.27 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.28 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.29 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.30 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.31 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.32 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.33 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.34 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.35 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.36 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.37 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.38 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.39 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.40 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.41 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.42 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.43 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.44 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.45 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.46 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.47 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.48 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.49 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.50 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.51 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.52 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.53 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.54 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.55 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.56 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.57 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.58 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.59 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

4.60 基金管理人其他重要事项
基金管理人其他重要事项:基金管理人其他重要事项

单位:人民币元

项目 本期 上年度可比期间

一、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

六、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

七、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

八、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

九、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

十、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

十一、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

十二、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

十三、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

十四、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

十五、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

十六、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

十七、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

十八、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

十九、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二十、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二十一、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二十二、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二十三、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二十四、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二十五、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二十六、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二十七、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二十八、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

二十九、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三十、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三十一、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三十二、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三十三、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三十四、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三十五、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三十六、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三十七、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三十八、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

三十九、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四十、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四十一、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四十二、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四十三、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四十四、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四十五、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四十六、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四十七、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四十八、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

四十九、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五十、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五十一、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五十二、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五十三、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五十四、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五十五、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五十六、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五十七、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五十八、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

五十九、本期经营活动产生的基金资产变动净值(基金净值)变动数(本期)

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2019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余额40,459,539.25元,是以以下债券作为质押:

债券品种 债券名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 国债逆回购 799,360.00 0.47

2 央行票据 34,258,000.00 29.23

3 企业债 34,258,000.00 29.23

4 金融债 59,275,640.00 51.00

5 企业债 15,143,000.00 8.94

6 中期票据 76,800,000.00 45.45

7 可转债(可交换债) 11,281,571.50 6.66

8 同业存单 - -

9 其他 - -

10 合计 197,740,071.50 171.74

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

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 160213 16附开13 120,000 11,456,000.00 6.26

2 10175016 MTFN01 100,000 10,354,000.00 6.71

3 10175016 MTFN01 100,000 10,354,000.00 6.71

4 10175016 MTFN01 100,000 10,354,000.00 6.71

5 10156061 15附开06 100,000 10,250,000.00 6.05

7.7 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。

7.8 本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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 本基金投资组合报告期末基金资产净值变动情况的说明

本报告期末本基金投资组合净值变动情况如下:

7.12.1 本基金投资组合报告期末基金资产净值变动情况的说明

本报告期末本基金投资组合净值变动情况如下:

7.12.2 本基金投资组合报告期末基金资产净值变动情况的说明

本报告期末本基金投资组合净值变动情况如下:

7.12.3 本基金投资组合报告期末基金资产净值变动情况的说明

本报告期末本基金投资组合净值变动情况如下:

7.12.4 本基金投资组合报告期末基金资产净值变动情况的说明