# 泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金 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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2019年8月24日

## §1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为2019年1月29日起至2019年6月30日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 泰康港股通地产指数 | |
| 基金主代码 | 006816 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019年1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 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 12,931,192.57份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 泰康港股通地产指数A | 泰康港股通地产指数C |
| 下属分级基金的交易代码: | 006816 | 006817 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 10,930,129.57份 | 2,001,063.00份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行 相应的调整。<br>股票投资方面,本基金在建仓期内,将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本。本基金还将根据标的指数成份股及其权重的变动,根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况,对其投资组合进行适时调整,以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。<br>本基金将定期、不定期对投资组合进行绩效评定,以衡量指数化投资过程中投资组合的跟踪表现,并通过控制跟踪误差进行风险管理。<br>债券投资方面,本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,投资于债券资产。信用策略中,本基金将重点分析发债主体的行业发展前景、市场地位、公司 治理、财务质量、融资目的等要素,综合评价并定期更新信用债券的信用等级;同时,结合宏观经济分析、合理预测信用利差曲线的变化,确定信用债券的 配置比例。可转换债券投资策略中,本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证 券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资,并采用期权定价模型等数量化估值 工具评定其投资价值,以合理价格买入。中小企业私募债的投资策略中,本基金主要基于信用品种投资,在此基础上 重点分析信用风险及流动性风险。 |
| 业绩比较基准 | 中证港股通地产指数收益率（使用估值汇率折算）*95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。<br>本基金主要投资香港证券市场,需承担汇率风险以及境外市场的风险。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 陈玮光 | 郭明 |
| | 联系电话 | 010-58753683 | (010)66105798 |
| | 电子邮箱 | chenwg06@taikangamc.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4001895522 | 95588 |
| 传真 | | 010-57818785 | (010)66105799 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.tkfunds.com.cn |
| 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 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

| 基金级别 | 泰康港股通地产指数A | 泰康港股通地产指数C |
|---|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月29日 – 2019年6月30日) | 报告期(2019年1月29日 – 2019年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 446,973.59 | 102,497.62 |
| 本期利润 | 668,202.14 | 362,339.09 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0621 | 0.1028 |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.12% | 5.97% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0404 | 0.0390 |
| 期末基金资产净值 | 11,599,207.46 | 2,120,614.04 |
| 期末基金份额净值 | 1.0612 | 1.0597 |

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)本基金所述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。

(4)本基金合同生效日为2019年1月29日,截至报告期末不满半年。

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

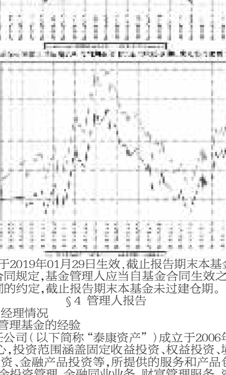
泰康港股通地产指数A

| 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 | 6.97% | 1.06% | 6.54% | 1.10% | 0.43% | -0.04% |
| 过去三个月 | -1.94% | 1.05% | -3.46% | 1.08% | 1.52% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.12% | 1.04% | 8.91% | 1.11% | -2.79% | -0.07% |

泰康港股通地产指数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 | 6.93% | 1.06% | 6.54% | 1.10% | 0.39% | -0.04% |
| 过去三个月 | -2.03% | 1.05% | -3.46% | 1.08% | 1.43% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.97% | 1.04% | 8.91% | 1.11% | -2.94% | -0.07% |

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



注:1、本基金基金合同于2019年01月29日生效,截止报告期末本基金未满一年。

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,截止报告期末本基金未建仓期。

## §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、金融产品投资等,所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至2018年12月31日,泰康资产管理资产总规模超过14000亿元。除管理泰康委托的资产外,泰康资产管理的第三方业务总规模突破7500亿元,另类投资管理规模超过3300亿元。目前泰康资产退休金管理规模超过2800亿元,其中企业年金管理规模超过2300亿元,是国内最大的企业年金投资管理人。

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。截至2019年6月30日,公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报3个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实3个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通TMT主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债6个月定期开放债券型证券投资基金、泰康安业政策性金融债债券型证券投资基金共35只证券投资基金。

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 任职日期 | 任本基金的基金经理(助理)期限 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 黄成扬 | 本基金基金经理 | 2019年1月29日 | – | 12 | 黄成扬于2017年7月加入泰康资产管理有限责任公司,现担任公募事业部投资部股票投资总监。2007年7月至2008年12月在金捷基金担任研究部研究员,2009年1月至2012年2月在恒星资产管理担任研究部研究员,2012年2月至2017年7月在长盛基金国际业务部历任高级研究员、专户投资经理、基金经理。2015年7月21日至2017年7月14日担任长盛环球景气行业大盘精选证券投资基金基金经理。2017年11月21日至今担任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年12月21日至今担任泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年1月29日至今担任泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年4月3日至今担任泰康中证港股通TMT主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年4月9日至今担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年4月16日至今担任泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金基金经理。 |
| 刘伟 | 本基金基金经理 | 2019年1月29日 | – | 8 | 刘伟于2011年6月加入泰康资产,历任风险控制部风险管理研究员、高级经理,公募事业部投资部金融工程研究员、基金经理助理。现任公募事业部投资部量化投资总监。2017年5月4日至今担任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年9月29日至今担任泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金经理。2018年2月6日至今担任泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金基金经理。2018年12月21日至今担任泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年1月29日至今担任泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年4月3日至今担任泰康中证港股通TMT主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年4月9日至今担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019年4月16日至今担任泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金基金经理。 |

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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。

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

宏观经济方面,2019年上半年经济平稳中小幅下滑,总体下行压力可控。出口的增速受到外需走弱、全球贸易割裂的影响有所下滑,是上半年经济较大的拖累项;同时,制造业投资受到出口的影响表现较弱,从而拖累总体投资增速有所下行。但消费增速受益于居民可支配收入的提升而有所上行,对经济形成支撑。通胀方面呈现了CPI向上、PPI向下的格局。货币条件方面,M2保持稳定;社融受益于宽信用政策的传导而明显改善;汇率则先升值后贬值,总体稳定。

权益市场方面,一季度全球股市普涨,A股市场大幅领先,港股市场相对滞后。我们认为股市上涨的主要原因来自于投资者心态的转变:包括对于经济前景和经济转型的看法从极度悲观转为相对中性乃至乐观,同时中美贸易谈判也随着中美不断互访取得了切实的进展和美联储停止加息进程,也似乎让投资者感觉到全球经济在通向衰退的道路上有所止步。进入二季度中美贸易谈判再度出现波折,虽然在6月底的G20峰会上两国领导人再度会面定下重启谈判,但仍然给全球的经济前景增加些许阴影。同时全球货币宽松的预期再度高启,投资者希望全球的央行在提振经济,但这一次宽松的力度能有多大,对于经济的刺激能有多强,仍然有待评定。从数据和板块上看,上半年从上证综指上涨19.45%,沪深300上涨27.07%,恒生指数上涨10.43%,其中港股消费品与建筑地产行业涨幅靠前,港股原材料、电讯、能源等行业表现不佳。

具体操作方面,在无大额申购或赎回等特殊情况时,基金基本保持了较高的仓位,注重保持精细化管理,较好的实现了跟踪误差控制目标,指数跟踪效果良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康港股通地产指数C基金份额净值为1.0597元，本报告期基金份额净值增长率为5.97%;截至本报告期末泰康港股通地产指数A基金份额净值为1.0612元,本报告期基金份额净值增长率为6.12%;同期业绩比较基准增长率为8.91%。

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2019年下半年,基本面下行的压力没有完全释放,但预计下行斜率缓慢。全球贸易环境割裂、外需维持低位,对出口的造成负面影响;同时地产投资随着前期拿地和新开工的下行,地产资金链边际趋紧,也将步入下行通道,但另一方面,基建投资有望形成对冲,消费在汽车缓慢复苏的背景下也有所支持。政策上将在稳增长和防风险之间保持平衡和灵活性,财政政策继续落实减税降费、盘活存量;货币政策将保持流动性合理充裕,同时加速推进利率市场化改革,引导实际贷款利率的下行。

权益市场方面,2019年以来,国内宏观经济数据虽然有所下滑,但整体韧性仍在,海外特别是美国的宏观数据所呈现缓慢回落的态势,市场的博弈点更为侧重各大央行的货币政策以及各国的财政政策。展望下半年,关于政策的博弈仍将持续,但困难在于市场已经在一定程度上反应了宽松的预期。

下半年我们将紧密跟踪经济和市场变化,保持精细化管理,控制跟踪误差,力争把握机会、规避风险,为基金持有人取得较好回报。

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,设有公募估值小组,并制定了相关制度及流程。公司公募估值小组设成员若干名,成员由公募各相关部门组成,包括风险控制部、运营管理部、投资部、监察稽核部等。公募估值小组成员均具有相关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，并经托管银行复核确认。

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2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日本基金未进行利润分配。

## §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,本基金托管人在对泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金的管理人——泰康资产管理有限责任公司在泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泰康资产管理有限责任公司编制和披露的泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## §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:泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2019年6月30日 |
|---|---|
| 资产: | |
| 银行存款 | 276,972.37 |
| 结算备付金 | – |
| 存出保证金 | 108.18 |
| 交易性金融资产 | 13,404,531.86 |
| 其中:股票投资 | 12,655,131.86 |
| 基金投资 | – |
| 债券投资 | 749,400.00 |
| 资产支持证券投资 | – |
| 贵金属投资 | – |
| 衍生金融资产 | – |
| 买入返售金融资产 | – |
| 应收证券清算款 | – |
| 应收利息 | 7,895.54 |
| 应收股利 | 118,257.16 |
| 应收申购款 | 19,027.11 |
| 递延所得税资产 | – |
| 其他资产 | – |
| 资产总计 | 13,826,792.22 |
| **负债和所有者权益** | **本期末 2019年6月30日** |
| 负债: | |
| 短期借款 | – |
| 交易性金融负债 | – |
| 衍生金融负债 | – |
| 卖出回购金融资产款 | – |
| 应付证券清算款 | 2.78 |
| 应付赎回款 | 73,447.47 |
| 应付管理人报酬 | 5,497.12 |
| 应付托管费 | 1,099.44 |
| 应付销售服务费 | 714.93 |
| 应付交易费用 | 2,547.55 |
| 应交税费 | – |
| 应付利息 | – |
| 应付利润 | – |
| 递延所得税负债 | – |
| 其他负债 | 23,661.43 |
| 负债合计 | 106,970.72 |
| 所有者权益: | |
| 实收基金 | 12,931,192.57 |
| 未分配利润 | 788,628.93 |
| 所有者权益合计 | 13,719,821.50 |
| 负债和所有者权益总计 | 13,826,792.22 |

注:本基金合同生效日为2019年1月29日,本报告期自基金合同生效日2019年1月29日起至2019年6月30日止,报告截止日2019年6月30日,泰康港股通地产指数A基金份额净值1.0612元,基金份额总额10,930,129.57份;泰康港股通地产指数C基金份额净值1.0597元,基金份额总额2,001,063.00份。泰康港股通地产指数份额总额合计为12,931,192.57份。

6.2 利润表

会计主体:泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金

本报告期:2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日 |
|---|---|
| 一、收入 | 1,148,884.77 |
| 1.利息收入 | 22,544.96 |
| 其中:存款利息收入 | 5,283.37 |
| 债券利息收入 | 8,643.94 |
| 资产支持证券利息收入 | – |
| 买入返售金融资产收入 | 8,617.65 |
| 其他利息收入 | – |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 642,693.97 |
| 其中:股票投资收益 | 417,356.90 |
| 基金投资收益 | – |
| 债券投资收益 | -2,664.00 |
| 资产支持证券投资收益 | – |
| 贵金属投资收益 | – |
| 衍生工具收益 | – |
| 股利收益 | 228,001.07 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 481,070.02 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | – |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 2,575.82 |
| 减:二、费用 | 118,343.54 |
| 1. 管理人报酬 | 30,599.64 |
| 2. 托管费 | 6,119.86 |
| 3. 销售服务费 | 6,008.67 |
| 4. 交易费用 | 43,965.28 |
| 5. 利息支出 | 145.86 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 145.86 |
| 6. 税金及附加 | – |
| 7. 其他费用 | 31,504.23 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 1,030,541.23 |
| 减:所得税费用 | – |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 1,030,541.23 |

注: 本基金合同生效日为2019年1月29日, 本期是指自基金合同生效日2019年1月29日至2019年6月30日止期间,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金

本报告期:2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 14,437,677.59 | – | 14,437,677.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | 1,030,541.23 | 1,030,541.23 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | -1,506,485.02 | -241,912.30 | -1,748,397.32 |
| 其中:1.基金申购款 | 6,800,177.65 | 300,497.62 | 7,100,675.27 |
| 2.基金赎回款 | -8,306,662.67 | -542,409.92 | -8,849,072.59 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | – | – | – |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 12,931,192.57 | 788,628.93 | 13,719,821.50 |

注: 本基金合同生效日为2019年1月29日, 本期是指自基金合同生效日2019年1月29日至2019年6月30日止期间,无上年度可比期间数据。

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:

段国圣 金志刚 李俊佑

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

泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金(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[2018]2088号《关于准予泰康中证港股通地产指数型发起式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《泰康中证港股通地产指数型发起式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14,436,805.91元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第1900157号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金基金合同》于2019年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为14,437,677.59份基金份额,其中认购资金利息折合871.68份基金份额。本基金的基金管理人为泰康资产管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称"工商银行")。

根据《泰康中证港股通地产指数型发起式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《泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括港股通标的股票,并包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券资产(包括但不限于国债、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、可交换债券、分离交易可转债、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、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%;本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、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的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:中证港股通地产指数收益率(使用估值汇率折算)*95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*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》、各项具体会计准则及相关规定(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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《泰康中证港股通地产指数型发起式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2019年1月29日(基金合同生效日)至2019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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。

当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的该类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引"),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[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》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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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 |
|---|---|
| 泰康保险集团股份有限公司 | 基金管理人控股股东 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 泰康资产管理有限责任公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日,本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 30,599.64 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 3,365.91 |

注: 支付基金管理人泰康资产管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%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:

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,119.86 |

注:支付基金托管人工商银行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:

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
|---|---|---|---|
| | 泰康港股通地产指数A | 泰康港股通地产指数C | 合计 |
| 泰康资产管理有限责任公司 | – | 2,511.63 | 2,511.63 |
| 工商银行 | – | 2,731.00 | 2,731.00 |
| 合计 | – | 5,242.63 | 5,242.63 |

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0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给泰康资产管理有限责任公司,再由泰康资产管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

C类基金份额日销售服务费＝C类基金份额前一日基金资产净值 X 0.40% ÷ 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日,本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 泰康港股通地产指数A | 泰康港股通地产指数C |
| 基金合同生效日(2019年1月29日)持有的基金份额 | 9,900,495.05 | 100,005.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 9,900,495.05 | 100,005.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | – | – |
| 报告期间因拆分变动份额 | – | – |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额 | – | – |
| 报告期末持有的基金份额 | 9,900,495.05 | 100,005.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 90.5799% | 4.9976% |

6.4.8.4.2 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,本基金管理人之外的其他关联方未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.5 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 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 |
| 工商银行 | 276,972.37 | 4,002.02 | – | – |

注:本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日,本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日,本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为12,655,131.86元,属于第二层次的余额为749,400.00元,无属于第三层次的余额。

(ii)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;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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,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 | 12,655,131.86 | 91.53 |
| | 其中:股票 | 12,655,131.86 | 91.53 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 749,400.00 | 5.42 |
| | 其中:债券 | 749,400.00 | 5.42 |
| | 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 | 276,972.37 | 2.00 |
| 8 | 其他各项资产 | 145,287.99 | 1.05 |
| 9 | 合计 | 13,826,792.22 | 100.00 |

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为12,655,131.86元,占期末资产净值比例为92.24%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有指数投资境内股票。

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| A 基础材料 | – | – |
| B 消费者非必需品 | – | – |
| C 消费者常用品 | – | – |
| D 能源 | – | – |
| E 金融 | – | – |
| F 医疗保健 | – | – |
| G 工业 | 55,506.55 | 0.40 |
| H 信息技术 | – | – |
| I 电信服务 | – | – |
| J 公用事业 | – | – |
| K 房地产 | 12,599,625.31 | 91.84 |
| 合计 | 12,655,131.86 | 92.24 |

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 01113 | 长实集团 | 21,000 | 1,129,615.39 | 8.23 |
| 2 | 00016 | 新鸿基地产 | 9,500 | 1,107,272.03 | 8.07 |
| 3 | 02007 | 碧桂园 | 88,000 | 919,631.75 | 6.70 |
| 4 | 00688 | 中国海外发展 | 36,000 | 912,031.49 | 6.65 |
| 5 | 01918 | 融创中国 | 22,000 | 743,136.77 | 5.42 |
| 6 | 01109 | 华润置地 | 22,000 | 665,726.69 | 4.85 |
| 7 | 03333 | 中国恒大 | 32,000 | 616,465.73 | 4.49 |
| 8 | 00017 | 新世界发展 | 49,000 | 526,722.81 | 3.84 |
| 9 | 01997 | 九龙仓置业 | 10,000 | 484,252.83 | 3.53 |
| 10 | 00012 | 恒基地产 | 12,100 | 458,219.29 | 3.34 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 00016 | 新鸿基地产 | 2,228,033.01 | 16.24 |
| 2 | 01113 | 长实集团 | 1,776,026.42 | 12.94 |
| 3 | 00688 | 中国海外发展 | 1,347,460.97 | 9.82 |
| 4 | 02007 | 碧桂园 | 1,194,016.29 | 8.70 |
| 5 | 01109 | 华润置地 | 1,091,847.70 | 7.96 |
| 6 | 03333 | 中国恒大 | 1,041,537.53 | 7.59 |
| 7 | 01918 | 融创中国 | 944,101.16 | 6.88 |
| 8 | 00017 | 新世界发展 | 804,086.49 | 5.86 |
| 9 | 00012 | 恒基地产 | 707,635.82 | 5.16 |
| 10 | 01997 | 九龙仓置业 | 667,388.11 | 4.86 |
| 11 | 00083 | 信和置业 | 496,195.13 | 3.62 |
| 12 | 00960 | 龙湖地产 | 485,773.39 | 3.54 |
| 13 | 02202 | 万科企业 | 469,137.18 | 3.42 |
| 14 | 00101 | 恒隆地产 | 441,768.96 | 3.22 |
| 15 | 01972 | 太古地产 | 435,053.83 | 3.17 |
| 16 | 00020 | 会德丰 | 407,760.19 | 2.97 |
| 17 | 00004 | 九龙仓集团 | 351,315.39 | 2.56 |
| 18 | 00014 | 希慎兴业 | 324,051.52 | 2.36 |
| 19 | 00683 | 嘉里建设 | 271,026.21 | 1.98 |
| 20 | 00054 | 合和实业 | 269,405.23 | 1.96 |

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末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 00016 | 新鸿基地产 | 1,156,238.78 | 8.43 |
| 2 | 01113 | 长实集团 | 610,166.61 | 4.45 |
| 3 | 01109 | 华润置地 | 546,813.68 | 3.99 |
| 4 | 00688 | 中国海外发展 | 454,623.61 | 3.31 |
| 5 | 02007 | 碧桂园 | 384,704.41 | 2.80 |
| 6 | 01918 | 融创中国 | 371,661.57 | 2.71 |
| 7 | 03333 | 中国恒大 | 366,948.65 | 2.67 |
| 8 | 00012 | 恒基地产 | 285,922.05 | 2.08 |
| 9 | 00017 | 新世界发展 | 282,700.24 | 2.06 |
| 10 | 00054 | 合和实业 | 266,562.59 | 1.94 |
| 11 | 01997 | 九龙仓置业 | 201,392.43 | 1.47 |
| 12 | 00960 | 龙湖地产 | 191,031.45 | 1.39 |
| 13 | 01972 | 太古地产 | 185,440.04 | 1.35 |
| 14 | 00101 | 恒隆地产 | 163,638.89 | 1.19 |
| 15 | 01030 | 新城发展控股 | 162,480.54 | 1.18 |
| 16 | 00083 | 信和置业 | 147,555.65 | 1.08 |
| 17 | 00014 | 希慎兴业 | 145,426.05 | 1.06 |
| 18 | 00004 | 九龙仓集团 | 137,119.87 | 1.00 |
| 19 | 00087 | 太古股份公司Ｂ | 134,378.69 | 0.98 |
| 20 | 03380 | 龙光地产 | 129,681.04 | 0.95 |

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。

(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 | 19,606,230.10 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 7,850,650.16 |

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 | 749,400.00 | 5.46 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | – | – |
| | 其中:政策性金融债 | – | – |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债(可交换债) | – | – |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 749,400.00 | 5.46 |

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

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 | 019611 | 19国债01 | 7,500 | 749,400.00 | 5.46 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 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

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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 | 108.18 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | 118,257.16 |
| 4 | 应收利息 | 7,895.54 |
| 5 | 应收申购款 | 19,027.11 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 145,287.99 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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 持有份额 | 机构投资者 占总份额比例 | 个人投资者 持有份额 | 个人投资者 占总份额比例 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 泰康港股通地产指数A | 270 | 40,481.96 | 9,900,495.05 | 90.58% | 1,029,634.52 | 9.42% |
| 泰康港股通地产指数C | 282 | 7,095.97 | 100,005.00 | 5.00% | 1,901,058.00 | 95.00% |
| 合计 | 517 | 25,011.98 | 10,000,500.05 | 77.34% | 2,930,692.52 | 22.66% |

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 | 泰康港股通地产指数A | 10,002.83 | 0.0915% |
| | 泰康港股通地产指数C | 26,550.12 | 1.3268% |
| | 合计 | 36,552.95 | 0.2827% |

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的情况

| 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 泰康港股通地产指数A | 0 |
| | 泰康港股通地产指数C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 泰康港股通地产指数A | 0 |
| | 泰康港股通地产指数C | 0 |
| | 合计 | 0 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,500.05 | 77.34 | 10,000,500.05 | 77.34 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | – | – | – | – | – |
| 基金经理等人员 | – | – | – | – | – |
| 基金管理人股东 | – | – | – | – | – |
| 其他 | – | – | – | – | – |
| 合计 | 10,000,500.05 | 77.34 | 10,000,500.05 | 77.34 | – |

## §9 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 泰康港股通地产指数A | 泰康港股通地产指数C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2019年1月29日)基金份额总额 | 10,149,773.37 | 4,287,904.22 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 1,843,862.31 | 4,956,315.34 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 1,063,506.11 | 7,243,156.56 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | – | – |
| 本报告期期末基金份额总额 | 10,930,129.57 | 2,001,063.00 |

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

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

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

本报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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 成交金额 | 股票交易 占当期股票成交总额的比例 | 应支付该券商的佣金 佣金 | 应支付该券商的佣金 占当期佣金总量的比例 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 华创证券 | 2 | 27,456,880.26 | 100.00% | 8,237.06 | 100.00% | – |
| 东方证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 中金公司 | 2 | – | – | – | – | – |
| 广发证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 方正证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 光大证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 招商证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 兴业证券 | 2 | – | – | – | – | – |

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

券商选择标准:协议券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定,即参选券商应满足以下条件:(1)经营业务比较全面,能够覆盖证券经纪、证券研究、投资银行、股指期货和融资融券等领域;(2)拥有独立的研究部门及20人以上的研究团队,研究范围覆盖宏观经济、金融市场和相关行业,并且已建立完善的研究报告质量保障机制;(3)投资银行实力较强,能够提供优质服务;(4)建立相关业务利益冲突防范机制,完善隔离墙制度,确保研究、投行服务客观公正;(5)承诺接受中国证监会、保险会有关保险机构证券交易情况的监督,并履行本通知规定的相关要求和报告义务;(6) 经评估符合向基金机构和保险机构投资提供交易单元的条件并经获准;(7)符合中国证监会、保监会规定的其他条件。除以上首要基本标准外,参选的券商还应当满足以下三个方面的要求:(1)公司财务状况良好,近一年内无重大违规事项;(2)在国内及海外市场拥有较高的市场声誉;(3)能够提供全方位的业务支持,包括但不仅限于、股指期货、融资融券、海外投资、QFII等业务方面的咨询意见。

券商选择程序:(1)公募集中交易室负责组织定期比选工作,根据公募事业部制定的规则和需求选择券商,并对符合规定的券商发出邀请函;(2)券商有权决定是否参选,参选的券商应在规定时间内回复邀请函,未在规定时间内回复邀请函的券商视为放弃参选;(3)参选券商应根据邀请函的要求提供参选方案,并配合公募事业部安排完成现场评述、现场答疑等基本程序;(4)公募事业部应本着公平客观的原则,从承担投资、研究等职能的相关岗位中抽取相关专业人员形成评审小组,评审小组根据评价要素、分工范围,对参选券商进行评分。公募集中交易室负责汇总打分,并根据各项权重计算评价结果;评审小组成员包括以下业务骨干:基金经理、研究员、信评研究员、股票交易员等承担投资、研究职能的相关专业人员。(5)为保证评选的客观性、公正性,公募合规岗应全程参加现场评选,并监督评选全过程。公募合规岗有权对妨碍客观、公正原则的行为予以制止和纠正;(6)公募集中交易室将协议券商的评选结果和拟定的协议券商的交易单元租用计划在办公系统中以呈批件的形式，报送参评人员会签，部门负责人审批;(7)待呈批件审批通过后,运营管理部负责与协议券商签订《证券交易单元租用协议》、办理交易单元联通及相关账户报备等工作;(8)公募集中交易室负责与协议券商签订《证券研究综合服务协议》;(9)信息管理部负责对交易单元进行测试;(10)定期比选方式选择的协议券商将纳入公募事业部佣金分配体系,根据公募事业部对其的定期评价打分结果,在租用的交易单元上实现交易佣金的合理分配;(11)定期比选原则上三年一次。

3、本报告期内本基金新增租用16个交易单元,分别为中国国际金融股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各1个,东方证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各1个,广发证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各1个,兴业证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各1个,方正证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各1个,华创证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各1个,光大证券有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各1个,招商证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各1个。

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 成交金额 | 债券交易 占当期债券成交总额的比例 | 债券回购交易 成交金额 | 债券回购交易 占当期债券回购成交总额的比例 | 权证交易 成交金额 | 权证交易 占当期权证成交总额的比例 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 华创证券 | 1,473,189.00 | 100.00% | 29,500,000.00 | 100.00% | – | – |
| 东方证券 | – | – | – | – | – | – |
| 中金公司 | – | – | – | – | – | – |
| 广发证券 | – | – | – | – | – | – |
| 方正证券 | – | – | – | – | – | – |
| 光大证券 | – | – | – | – | – | – |
| 招商证券 | – | – | – | – | – | – |
| 兴业证券 | – | – | – | – | – | – |

## §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 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 | 报告期末持有基金情况 持有份额 | 份额占比 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 机构 | 1 | 20190129 – 20190630 | 10,000,500.05 | – | – | 10,000,500.05 | 77.34% |
| 个人 | 1 | 20190129 – 20190225 | 3,000,150.00 | – | 3,000,150.00 | – | 0.00% |
| – | – | – | – | – | – | – | – |
| 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

泰康资产管理有限责任公司

2019年8月24日