

# 泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 泰康兴泰回报沪港深混合                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 基金主代码      | 004340                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 基金合同生效日    | 2017 年 6 月 15 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 报告期末基金份额总额 | 290,278,740.33 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过合理配置大类资产和精选投资标的，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 投资策略       | <p>本基金将充分发挥管理人在大类资产配置上的投研优势，综合运用定量分析和定性分析手段，全面评估证券市场当期的投资环境并对可以预见的未来时期内各大类资产的风险收益状况进行分析与预测。在此基础上，制定本基金在权益类资产与固收类资产上的战略配置比例，并定期或不定期地进行调整。</p> <p>权益类投资方面，在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与权益类资产的投资，以增加基金收益。本基金在股票基本面研究的基础上，同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的国内 A 股及内地与香港股票市场交易互联互通机制下的港股投资标的股票，以此构建股票组合。本基金通过对国内 A 股市场和港股市场跨市场的投资，来达到分散投资风险、增强基金整体收益的目的。</p> <p>固定收益类投资方面，本基金通过分析宏观经济</p> |

|                 |                                                                                                                                                                 |                |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|
|                 | 运行情况、判断经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。另外，本基金在分析各类债券资产的信用风险、流动性风险及其收益率水平的基础上，通过比较或合理预期各类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整优先配置的资产类别和配置比例。 |                |
| 业绩比较基准          | 20%*沪深 300 指数收益率+75%*中债新综合财富（总值）指数收益率+5%*金融机构人民币活期存款利率（税后）                                                                                                      |                |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。                                                                                                                      |                |
| 基金管理人           | 泰康基金管理有限公司                                                                                                                                                      |                |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司                                                                                                                                                      |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 泰康兴泰回报沪港深混合 A                                                                                                                                                   | 泰康兴泰回报沪港深混合 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 004340                                                                                                                                                          | 019110         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 283,909,058.77 份                                                                                                                                                | 6,369,681.56 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） |               |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
|                 | 泰康兴泰回报沪港深混合 A                       | 泰康兴泰回报沪港深混合 C |
| 1. 本期已实现收益      | -4,555,000.60                       | -101,785.46   |
| 2. 本期利润         | 4,774,225.09                        | 115,905.41    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0156                              | 0.0183        |
| 4. 期末基金资产净值     | 438,711,250.92                      | 9,813,118.73  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.5453                              | 1.5406        |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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）所述基金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。

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

泰康兴泰回报沪港深混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 | 业绩比较基 | 业绩比较基 | ①－③ | ②－④ |
|----|--------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|--------|-------|-------|-------|-----|-----|

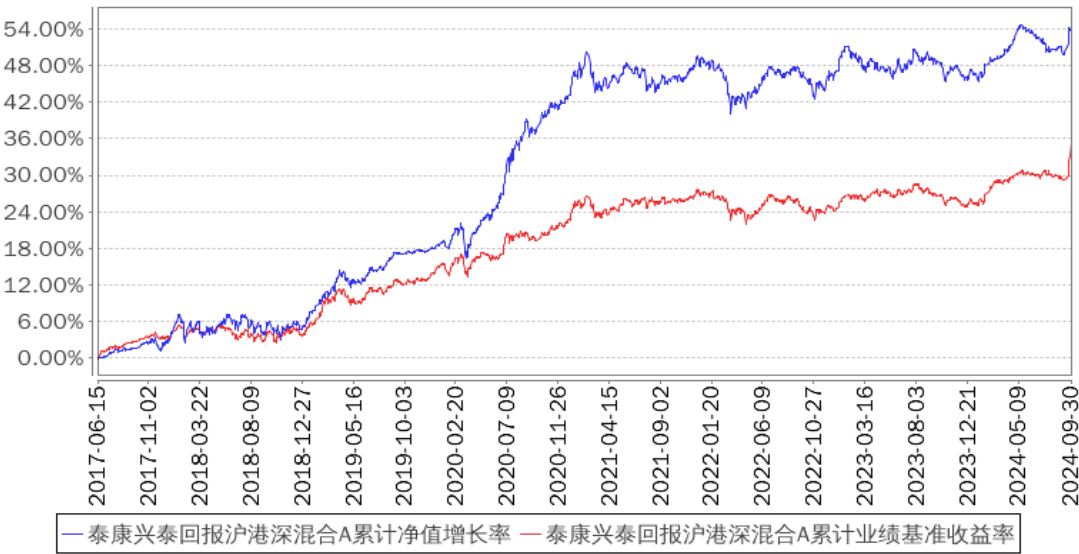
|            |        | 标准差②  | 准收益率③  | 准收益率标准差④ |        |        |
|------------|--------|-------|--------|----------|--------|--------|
| 过去三个月      | 1.26%  | 0.23% | 3.86%  | 0.28%    | -2.60% | -0.05% |
| 过去六个月      | 3.16%  | 0.21% | 4.79%  | 0.22%    | -1.63% | -0.01% |
| 过去一年       | 3.98%  | 0.22% | 6.66%  | 0.20%    | -2.68% | 0.02%  |
| 过去三年       | 6.15%  | 0.28% | 7.48%  | 0.21%    | -1.33% | 0.07%  |
| 过去五年       | 32.01% | 0.32% | 20.66% | 0.23%    | 11.35% | 0.09%  |
| 自基金合同生效起至今 | 54.53% | 0.32% | 35.11% | 0.23%    | 19.42% | 0.09%  |

泰康兴泰回报沪港深混合 C

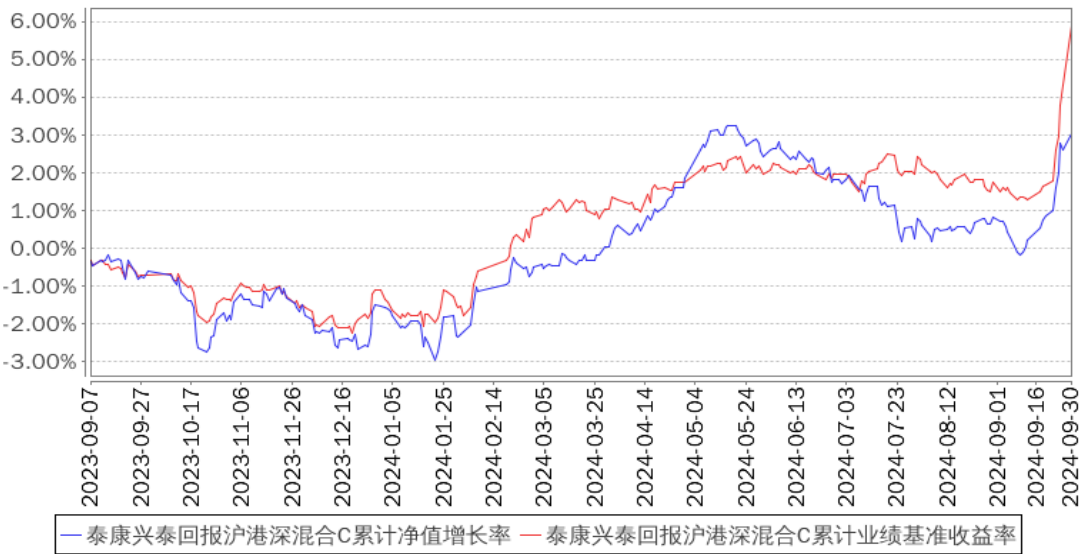
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 1.19%  | 0.23%     | 3.86%      | 0.28%         | -2.67% | -0.05% |
| 过去六个月      | 3.01%  | 0.21%     | 4.79%      | 0.22%         | -1.78% | -0.01% |
| 过去一年       | 3.66%  | 0.22%     | 6.66%      | 0.20%         | -3.00% | 0.02%  |
| 自基金合同生效起至今 | 3.03%  | 0.22%     | 5.88%      | 0.20%         | -2.85% | 0.02%  |

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

泰康兴泰回报沪港深混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰康兴泰回报沪港深混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2017 年 06 月 15 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。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

|     |                    | 任职日期            | 离任日期 | 年限   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|-----|--------------------|-----------------|------|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 桂跃强 | 本基金基金经理、权益投资部负责人   | 2017 年 6 月 15 日 | -    | 16 年 | <p>桂跃强于 2015 年 8 月加入泰康公募，担任公募事业部权益投资负责人。现任泰康基金权益投资部负责人、权益基金经理。曾任石油化工科学研究院工程师，新华基金管理有限公司基金管理部副总监、基金经理等职务。2015 年 12 月 8 日至 2024 年 7 月 8 日担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月 8 日至今担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 28 日至 2020 年 9 月 22 日担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 15 日至今担任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 20 日至 2020 年 7 月 2 日担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 13 日至 2020 年 1 月 10 日担任泰康景泰回报混合型证券投资基金基金经理。2018 年 1 月 19 日至 2020 年 1 月 10 日担任泰康均衡优选混合型证券投资基金基金经理。2018 年 5 月 30 日至今担任泰康颐年混合型证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 13 日至 2020 年 7 月 24 日担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 23 日至今担任泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 7 日担任泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 14 日至今担任泰康蓝筹优势一年持有期股票型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 22 日至今担任泰康优势企业混合型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 14 日至今担任泰康鼎泰一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p> |
| 蒋利娟 | 本基金基金经理、固定收益投资部负责人 | 2017 年 6 月 15 日 | -    | 16 年 | <p>蒋利娟于 2008 年 7 月加入泰康资产，历任集中交易室交易员、固定收益部固定收益投资经理。2014 年 11 月加入泰康公募，担任固定收益基金经理、公募事业部固定收益投资负责人。现任泰康基金固定收益投资部负责人、固定收益基金经理。2015 年 6 月 19 日至今担任泰</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 康薪意保货币市场基金基金经理。2015 年 9 月 23 日至 2020 年 1 月 6 日担任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 8 日至 2016 年 12 月 27 日担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 2 月 3 日至今担任泰康稳健增利债券型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月 8 日至今担任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 1 月 22 日至今担任泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 15 日至今担任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017 年 8 月 30 日至 2019 年 5 月 9 日担任泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 8 日至 2020 年 3 月 26 日担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。2018 年 5 月 30 日至今担任泰康颐年混合型证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 13 日至 2023 年 6 月 9 日担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 24 日至 2020 年 1 月 14 日担任泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 25 日至 2021 年 1 月 11 日担任泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 20 日至今担任泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 7 日至今担任泰康合润混合型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 2 日至今担任泰康浩泽混合型证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 31 日至今担任泰康稳健双利债券型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。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合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

#### 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，没有出现本基金管理人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 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，三季度延续了弱势运行、结构分化的特征。偏需求侧的消费增速表现较为疲弱，M2 和社融等金融指标继续下行，通胀维持低位，整体有所承压。9 月底的一揽子政策和政治局会议一定程度上扭转了低迷的市场预期，提振了信心，后续关注政策如何落地、以及经济企稳的可能。

债券市场方面，收益率先是震荡下行，在 9 月底出现了较为快速的抬升。央行买短卖长的操作，在给市场提供流动性支撑的同时，也一定程度上减缓了长端利率下行的节奏；但在经济需求不足和资产荒的背景下，利率总体趋势向下。在 9 月底的预期扭转之后，资产再平衡的行为在短期演绎得较为剧烈，利率有所回调。

权益市场方面，2024 年 3 季度先跌后涨，整体在季度末迎来快速修复，大幅反弹。从大盘指数整体表现上来看，3 季度上证指数上涨 12.44%，沪深 300 上涨 16.07%，创业板指上涨 29.21%，恒生综合指数上涨 18.07%，恒生科技上涨 33.69%。申万一级行业表现来看，非银金融、房地产、商贸零售、社会服务等行业相对表现较好，煤炭、石油石化、公用事业等行业相对较弱。

固收投资策略上，在利率债方面，根据市场形势调节仓位和久期；在信用债方面，由于信用利差较低，长久期信用债投资价值一般，因此信用债重点配置中短期限品种。

权益投资方面，基于偏债混合基金的特性，我们在权益投资方面力争稳中求胜。尽量选择公司治理良好，商业模式经过长期检验，估值合理的品种，并根据市场的情况，控制合理的仓位。



这一期，我们保持了相对谨慎的仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 份额净值为 1.5453 元,本报告期基金 A 份额净值增长率为 1.26%;  
截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.5406 元,本报告期基金 C 份额净值增长率为 1.19%; 同期  
业绩比较基准增长率为 3.86%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净  
值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例<br>（%） |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 83,554,796.63  | 13.27            |
|    | 其中：股票             | 83,554,796.63  | 13.27            |
| 2  | 基金投资              | —              | —                |
| 3  | 固定收益投资            | 526,032,387.68 | 83.56            |
|    | 其中：债券             | 526,032,387.68 | 83.56            |
|    | 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          | -169.72        | -0.00            |
|    | 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      | 19,699,450.56  | 3.13             |
| 8  | 其他资产              | 204,367.61     | 0.03             |
| 9  | 合计                | 629,490,832.76 | 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 46,827,390.55 元，占期末资  
产净值比例为 10.44%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比<br>例（%） |
|----|----------|--------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | —            | —                |
| B  | 采矿业      | 4,563,850.00 | 1.02             |

|   |                  |               |      |
|---|------------------|---------------|------|
| C | 制造业              | 32,163,556.08 | 7.17 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -    |
| E | 建筑业              | -             | -    |
| F | 批发和零售业           | -             | -    |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -    |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -    |
| J | 金融业              | -             | -    |
| K | 房地产业             | -             | -    |
| L | 租赁和商务服务业         | -             | -    |
| M | 科学研究和技术服务业       | -             | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -    |
| P | 教育               | -             | -    |
| Q | 卫生和社会工作          | -             | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -             | -    |
| S | 综合               | -             | -    |
|   | 合计               | 36,727,406.08 | 8.19 |

5.2.2 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      | 20,406,246.43 | 4.55         |
| E 金融      | -             | -            |
| F 医疗保健    | -             | -            |
| G 工业      | -             | -            |
| H 信息技术    | -             | -            |
| I 电信服务    | 26,421,144.12 | 5.89         |
| J 公用事业    | -             | -            |
| K 房地产     | -             | -            |
| 合计        | 46,827,390.55 | 10.44        |

注：以上行业分类标准来源于财汇。

5.3 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

5.3.1 报告期末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

| 序号 | 股票代码  | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 00700 | 腾讯控股 | 65,898  | 26,421,144.12 | 5.89         |
| 2  | 01088 | 中国神华 | 645,563 | 20,406,246.43 | 4.55         |

|   |        |      |         |               |      |
|---|--------|------|---------|---------------|------|
| 2 | 601088 | 中国神华 | 43,000  | 1,874,800.00  | 0.42 |
| 3 | 000333 | 美的集团 | 289,500 | 22,019,370.00 | 4.91 |
| 4 | 002311 | 海大集团 | 58,376  | 2,803,215.52  | 0.62 |
| 5 | 601225 | 陕西煤业 | 97,500  | 2,689,050.00  | 0.60 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 54,200  | 2,598,348.00  | 0.58 |
| 7 | 600660 | 福耀玻璃 | 43,100  | 2,508,420.00  | 0.56 |
| 8 | 600031 | 三一重工 | 118,337 | 2,234,202.56  | 0.50 |

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 115,221,926.63 | 25.69        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 190,702,770.87 | 42.52        |
|    | 其中：政策性金融债 | 35,539,867.40  | 7.92         |
| 4  | 企业债券      | 18,488,133.97  | 4.12         |
| 5  | 企业短期融资券   | 46,566,388.13  | 10.38        |
| 6  | 中期票据      | 122,839,766.56 | 27.39        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 32,213,401.52  | 7.18         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 526,032,387.68 | 117.28       |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称         | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 230026  | 23 付息国债 26   | 700,000 | 73,602,165.76 | 16.41        |
| 2  | 2228024 | 22 工商银行二级 03 | 300,000 | 31,360,232.88 | 6.99         |
| 3  | 2228039 | 22 建设银行二级 01 | 300,000 | 31,182,460.27 | 6.95         |
| 4  | 230012  | 23 付息国债 12   | 200,000 | 20,989,190.22 | 4.68         |
| 5  | 2128008 | 21 中国银行二级 01 | 200,000 | 20,986,558.90 | 4.68         |

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

宁波银行股份有限公司因消费者个人信息管理不到位、贷款“三查”不尽职等行为在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局宁波监管局的公开处罚；因违规置换已核销贷款在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局宁波监管局的公开处罚；因债券交易授权管理不到位在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局上海监管局的责令改正和公开处罚。

中国光大银行股份有限公司因投诉处理内部控制不严行为在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚。

中国建设银行股份有限公司因单个网点在同一会计年度内与超过 3 家保险公司开展保险业务合作等行为在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚；因并表管理内部审计存在不足等原因在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚。

中国银行股份有限公司因部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求等原因在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚；因办理经常项目资

金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查在本报告编制前一年内受到国家外汇管理局北京市分局的公开处罚；因代理销售保险夸大保险责任、承诺收益等欺骗投保人在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局北京监管局的公开处罚；因违反账户管理规定等原因在本报告编制前一年内受到中国人民银行的公开处罚与公开批评。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外，其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 9,987.77   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 194,379.84 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 204,367.61 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 127085 | 韵达转债    | 1,113,268.96 | 0.25         |
| 2  | 127038 | 国微转债    | 1,037,186.93 | 0.23         |
| 3  | 128141 | 旺能转债    | 904,299.84   | 0.20         |
| 4  | 118025 | 奕瑞转债    | 883,801.91   | 0.20         |
| 5  | 113641 | 华友转债    | 868,427.52   | 0.19         |
| 6  | 123115 | 捷捷转债    | 839,099.48   | 0.19         |
| 7  | 110084 | 贵燃转债    | 829,715.88   | 0.18         |
| 8  | 113051 | 节能转债    | 827,936.70   | 0.18         |
| 9  | 123194 | 百洋转债    | 827,782.14   | 0.18         |
| 10 | 118034 | 晶能转债    | 799,501.99   | 0.18         |
| 11 | 113632 | 鹤 21 转债 | 756,820.83   | 0.17         |
| 12 | 113661 | 福 22 转债 | 706,316.89   | 0.16         |
| 13 | 127045 | 牧原转债    | 697,496.05   | 0.16         |
| 14 | 118031 | 天 23 转债 | 688,320.92   | 0.15         |
| 15 | 110090 | 爱迪转债    | 653,413.19   | 0.15         |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 16 | 123150 | 九强转债    | 575,769.87 | 0.13 |
| 17 | 128081 | 海亮转债    | 561,731.95 | 0.13 |
| 18 | 110076 | 华海转债    | 542,857.52 | 0.12 |
| 19 | 128121 | 宏川转债    | 520,605.88 | 0.12 |
| 20 | 113675 | 新 23 转债 | 519,164.89 | 0.12 |
| 21 | 113682 | 益丰转债    | 508,478.20 | 0.11 |
| 22 | 123169 | 正海转债    | 502,020.59 | 0.11 |
| 23 | 123064 | 万孚转债    | 480,800.33 | 0.11 |
| 24 | 113579 | 健友转债    | 473,781.02 | 0.11 |
| 25 | 123121 | 帝尔转债    | 428,615.08 | 0.10 |
| 26 | 128137 | 洁美转债    | 412,087.42 | 0.09 |
| 27 | 110085 | 通 22 转债 | 370,720.80 | 0.08 |
| 28 | 127076 | 中宠转 2   | 363,727.22 | 0.08 |
| 29 | 127031 | 洋丰转债    | 344,664.21 | 0.08 |
| 30 | 113655 | 欧 22 转债 | 339,591.23 | 0.08 |
| 31 | 113637 | 华翔转债    | 328,698.12 | 0.07 |
| 32 | 113658 | 密卫转债    | 298,443.42 | 0.07 |
| 33 | 123119 | 康泰转 2   | 292,711.99 | 0.07 |
| 34 | 113062 | 常银转债    | 285,788.81 | 0.06 |
| 35 | 113052 | 兴业转债    | 276,932.07 | 0.06 |
| 36 | 110075 | 南航转债    | 275,929.77 | 0.06 |
| 37 | 127030 | 盛虹转债    | 271,795.98 | 0.06 |
| 38 | 113644 | 艾迪转债    | 267,247.01 | 0.06 |
| 39 | 113047 | 旗滨转债    | 255,227.58 | 0.06 |
| 40 | 113616 | 韦尔转债    | 250,971.13 | 0.06 |
| 41 | 110094 | 众和转债    | 247,471.51 | 0.06 |
| 42 | 127020 | 中金转债    | 243,980.00 | 0.05 |
| 43 | 113042 | 上银转债    | 240,573.59 | 0.05 |
| 44 | 127069 | 小熊转债    | 235,419.18 | 0.05 |
| 45 | 123208 | 孩王转债    | 228,544.20 | 0.05 |
| 46 | 123229 | 艾录转债    | 218,217.18 | 0.05 |
| 47 | 123202 | 祥源转债    | 215,668.01 | 0.05 |
| 48 | 123191 | 智尚转债    | 213,790.59 | 0.05 |
| 49 | 118014 | 高测转债    | 209,758.28 | 0.05 |
| 50 | 123117 | 健帆转债    | 200,487.57 | 0.04 |
| 51 | 128133 | 奇正转债    | 198,103.27 | 0.04 |
| 52 | 111002 | 特纸转债    | 196,714.58 | 0.04 |
| 53 | 123059 | 银信转债    | 194,624.17 | 0.04 |
| 54 | 127035 | 濮耐转债    | 188,898.63 | 0.04 |
| 55 | 127100 | 神码转债    | 187,250.45 | 0.04 |
| 56 | 113648 | 巨星转债    | 182,628.68 | 0.04 |
| 57 | 113021 | 中信转债    | 181,033.69 | 0.04 |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 58 | 127027 | 能化转债    | 178,589.79 | 0.04 |
| 59 | 123025 | 精测转债    | 177,906.15 | 0.04 |
| 60 | 127028 | 英特转债    | 174,581.02 | 0.04 |
| 61 | 110062 | 烽火转债    | 169,598.10 | 0.04 |
| 62 | 113672 | 福蓉转债    | 165,566.63 | 0.04 |
| 63 | 111018 | 华康转债    | 159,872.75 | 0.04 |
| 64 | 123109 | 昌红转债    | 158,003.05 | 0.04 |
| 65 | 123184 | 天阳转债    | 155,997.99 | 0.03 |
| 66 | 113631 | 皖天转债    | 154,200.03 | 0.03 |
| 67 | 128083 | 新北转债    | 154,087.13 | 0.03 |
| 68 | 113060 | 浙 22 转债 | 153,497.08 | 0.03 |
| 69 | 123176 | 精测转 2   | 149,924.22 | 0.03 |
| 70 | 113588 | 润达转债    | 147,998.19 | 0.03 |
| 71 | 123170 | 南电转债    | 144,162.82 | 0.03 |
| 72 | 110067 | 华安转债    | 142,421.05 | 0.03 |
| 73 | 127078 | 优彩转债    | 142,299.54 | 0.03 |
| 74 | 113039 | 嘉泽转债    | 141,635.90 | 0.03 |
| 75 | 113066 | 平煤转债    | 140,734.47 | 0.03 |
| 76 | 123107 | 温氏转债    | 139,093.40 | 0.03 |
| 77 | 123050 | 聚飞转债    | 138,109.00 | 0.03 |
| 78 | 113043 | 财通转债    | 137,213.59 | 0.03 |
| 79 | 127073 | 天赐转债    | 135,309.24 | 0.03 |
| 80 | 123090 | 三诺转债    | 134,745.38 | 0.03 |
| 81 | 113652 | 伟 22 转债 | 134,542.93 | 0.03 |
| 82 | 111010 | 立昂转债    | 133,519.08 | 0.03 |
| 83 | 110059 | 浦发转债    | 132,972.76 | 0.03 |
| 84 | 127059 | 永东转 2   | 124,242.90 | 0.03 |
| 85 | 118033 | 华特转债    | 116,602.76 | 0.03 |
| 86 | 123201 | 纽泰转债    | 114,787.29 | 0.03 |
| 87 | 113671 | 武进转债    | 112,280.96 | 0.03 |
| 88 | 123172 | 漱玉转债    | 101,317.81 | 0.02 |
| 89 | 123210 | 信服转债    | 94,318.08  | 0.02 |
| 90 | 113623 | 凤 21 转债 | 91,014.90  | 0.02 |
| 91 | 113058 | 友发转债    | 90,431.61  | 0.02 |
| 92 | 127040 | 国泰转债    | 89,440.16  | 0.02 |
| 93 | 118021 | 新致转债    | 87,359.26  | 0.02 |
| 94 | 118004 | 博瑞转债    | 73,237.07  | 0.02 |
| 95 | 110068 | 龙净转债    | 67,231.77  | 0.01 |
| 96 | 123131 | 奥飞转债    | 63,702.15  | 0.01 |
| 97 | 113678 | 中贝转债    | 61,441.05  | 0.01 |
| 98 | 113569 | 科达转债    | 54,816.51  | 0.01 |
| 99 | 110082 | 宏发转债    | 45,473.44  | 0.01 |

|     |        |       |           |      |
|-----|--------|-------|-----------|------|
| 100 | 127046 | 百润转债  | 41,506.10 | 0.01 |
| 101 | 111012 | 福新转债  | 2,387.10  | 0.00 |
| 102 | 123108 | 乐普转 2 | 210.60    | 0.00 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 泰康兴泰回报沪港深混合<br>A | 泰康兴泰回报沪港深混合<br>C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 341,748,080.16   | 6,313,871.02     |
| 报告期期间基金总申购份额              | 596,197.30       | 62,453.61        |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 58,435,218.69    | 6,643.07         |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                | -                |
| 报告期期末基金份额总额               | 283,909,058.77   | 6,369,681.56     |

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金注册的文件；
- （二）《泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金合同》；
- （三）《泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金招募说明书》；
- （四）《泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金托管协议》；
- （五）《泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金产品资料概要》。

### 9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康基金管理有限公司

2024 年 10 月 24 日