# 泰康均衡优选混合型证券投资基金
# 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

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

送出日期：2019 年 3 月 27 日

# §1 重要提示及目录

## 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期为 2018 年 1 月 19 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录 2**
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
**§2 基金简介 5**
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
**§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7**
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
**§4 管理人报告 12**
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15
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 16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 18
**§5 托管人报告 19**
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 19
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 19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 19
**§6 审计报告 20**
6.1 审计报告基本信息 20
6.2 审计报告的基本内容 20
**§7 年度财务报表 23**
7.1 资产负债表 23
7.2 利润表 24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 25
7.4 报表附注 26
**§8 投资组合报告 51**
8.1 期末基金资产组合情况 51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 57
8.6 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 57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细 57

8.8 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 .....57
8.9 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 .....57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....57
8.12 投资组合报告附注 .....58
**§9 基金份额持有人信息 .....59**
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....59
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....**错误!未定义书签。**
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....59
9.4 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 .....59
**§10 开放式基金份额变动 .....60**
**§11 重大事件揭示 .....61**
11.1 基金份额持有人大会决议 .....61
11.2 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 .....61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....61
11.4 基金投资策略的改变 .....61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....61
11.8 其他重大事件 .....64
**§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....67**
12.1 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 .....67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....67
**§13 备查文件目录 .....68**
13.1 备查文件目录 .....68
13.2 存放地点 .....68
13.3 查阅方式 .....68

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 泰康均衡优选混合 | |
| 基金主代码 | 005474 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 1 月 19 日 | |
| 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 674,343,532.22 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称： | 泰康均衡优选混合 A | 泰康均衡优选混合 C |
| 下属分级基金的交易代码： | 005474 | 005475 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 674,340,556.28 份 | 2,975.94 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过“自下而上”精选具有真实业绩支撑、成长性相对确定并匹配合理估值的个股，构建在风格、行业配置上相对均衡的组合并严格控制风险，力争基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动式组合管理获得超过业绩比较基准的收益。<br>本基金将利用基金管理人多年来在宏观经济分析上的丰富经验和积累，通过基金管理人自身研发构建的固定收益投资决策分析体系和权益投资决策分析体系定期评估宏观经济和投资环境，并对全球及国内经济发展进行评估和展望。在此基础上，通过定性定量分析判断未来市场投资环境的变化以及市场发展的主要推动因素，预测关键经济变量，并运用泰康资产配置模型，根据股票和债券资产的预期收益和风险，确定资产配置比例。<br>在股票投资上，本基金将“自下而上”精选具有真实业绩支撑、成长性相对确定并匹配合理估值的个股进行投资；构建组合时，将注重从风格（成长、价值）、行业上进行相对均衡的分散，并适当结合港股通投资实现跨市场风险分散，从而控制个股风险。<br>债券投资方面，本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，动态调整组合的久期。信用品种策略方面，本基金将综合发行人行业状况、业务发展状况、企业市场地位、财务状况、管理水平、债务水平等因素，挑选有投资价值的债券。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*75%+中债新综合财富（总值）指数收益率*20%+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。 |

## 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 | 招商银行股份有限公司 |
|---|---|---|---|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 陈玮光 | 张燕 |
| | 联系电话 | 010-58753683 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | chenwg06@taikangamc.com.cn | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 4001895522 | 95555 |
| 传真 | | 010-57818785 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 办公地址 | | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 100033 | 518040 |
| 法定代表人 | | 段国圣 | 李建红 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.tkfunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人办公地、基金托管人的住所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 泰康资产管理有限责任公司 | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层 |

# §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 泰康均衡优选混合 A | 泰康均衡优选混合 C |
| 本期已实现收益 | -70,046,279.76 | -14,192.40 |
| 本期利润 | -151,913,734.02 | -7,744.07 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2096 | -0.0543 |
| 本期加权平均净值利润率 | -22.70% | -6.51% |
| 本期基金份额净值增长率 | -21.39% | -21.51% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末 | |
| 期末可供分配利润 | -144,217,678.06 | -640.05 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2139 | -0.2151 |
| 期末基金资产净值 | 530,122,878.22 | 2,335.89 |
| 期末基金份额净值 | 0.7861 | 0.7849 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2018 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | -21.39% | -21.51% |

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 2018 年 1 月 19 日，截至报告期末不满一年。

## 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

泰康均衡优选混合 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -11.94% | 1.64% | -8.87% | 1.23% | -3.07% | 0.41% |
| 过去六个月 | -19.96% | 1.49% | -9.91% | 1.12% | -10.05% | 0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | -21.39% | 1.34% | -21.52% | 1.02% | 0.13% | 0.32% |

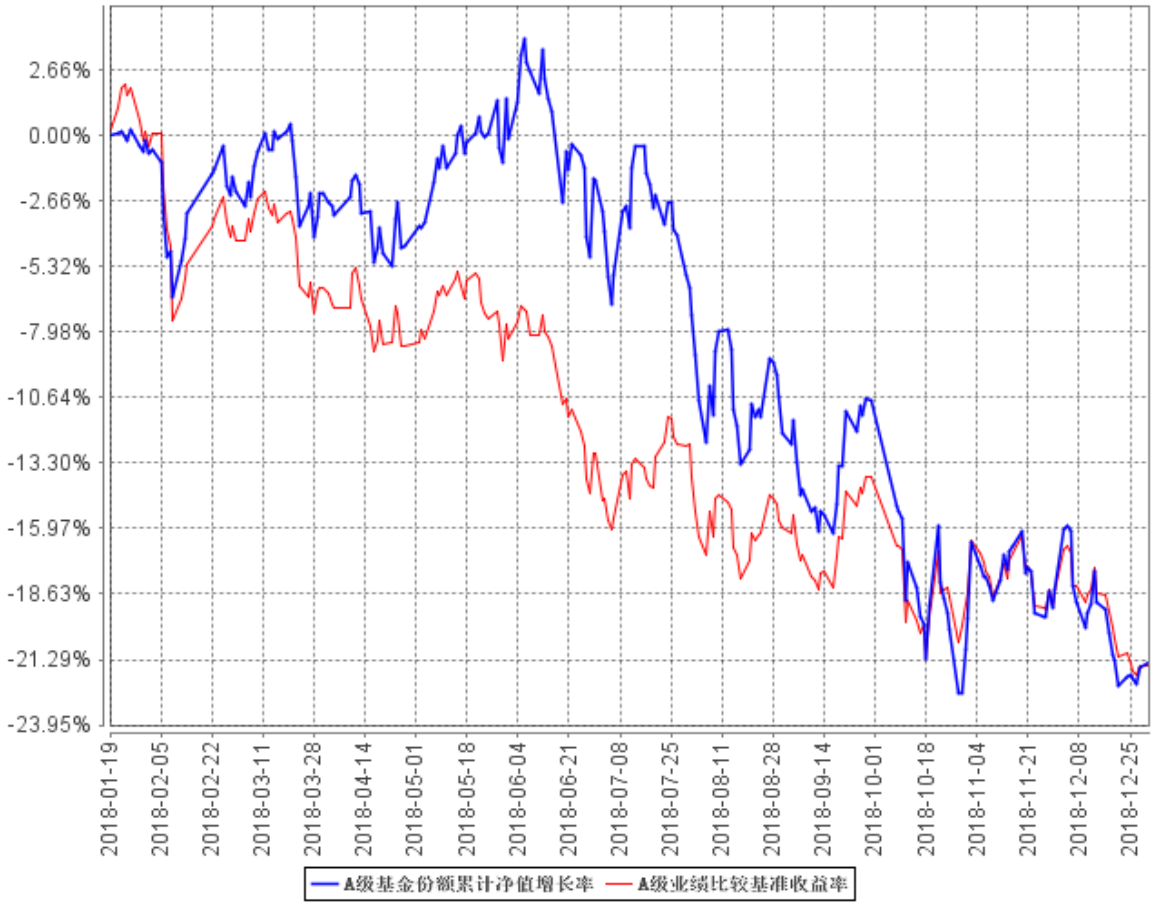
泰康均衡优选混合 C

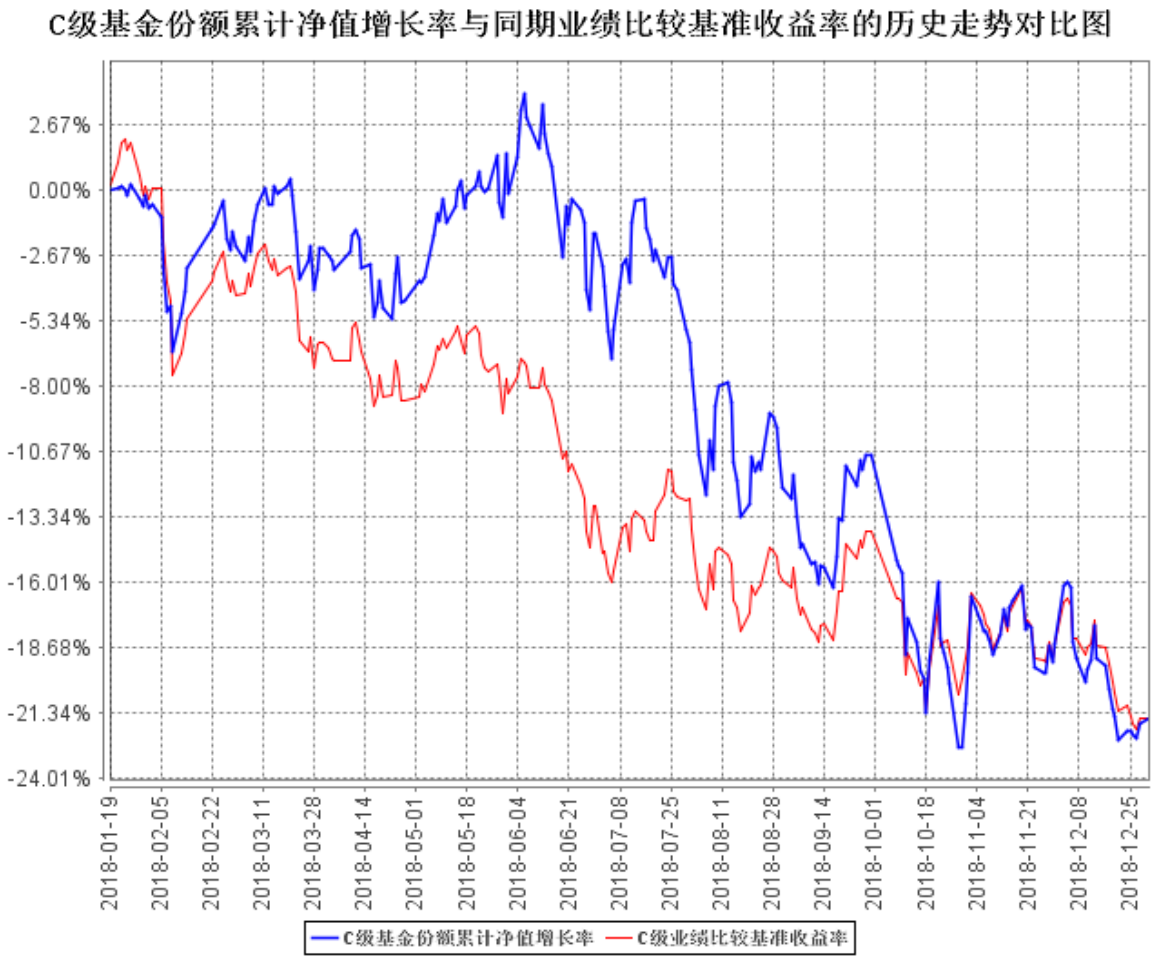
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -12.03% | 1.64% | -8.87% | 1.23% | -3.16% | 0.41% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去六个月 | -20.08% | 1.49% | -9.91% | 1.12% | -10.17% | 0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | -21.51% | 1.34% | -21.52% | 1.02% | 0.01% | 0.32% |

### 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

A级基金份额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



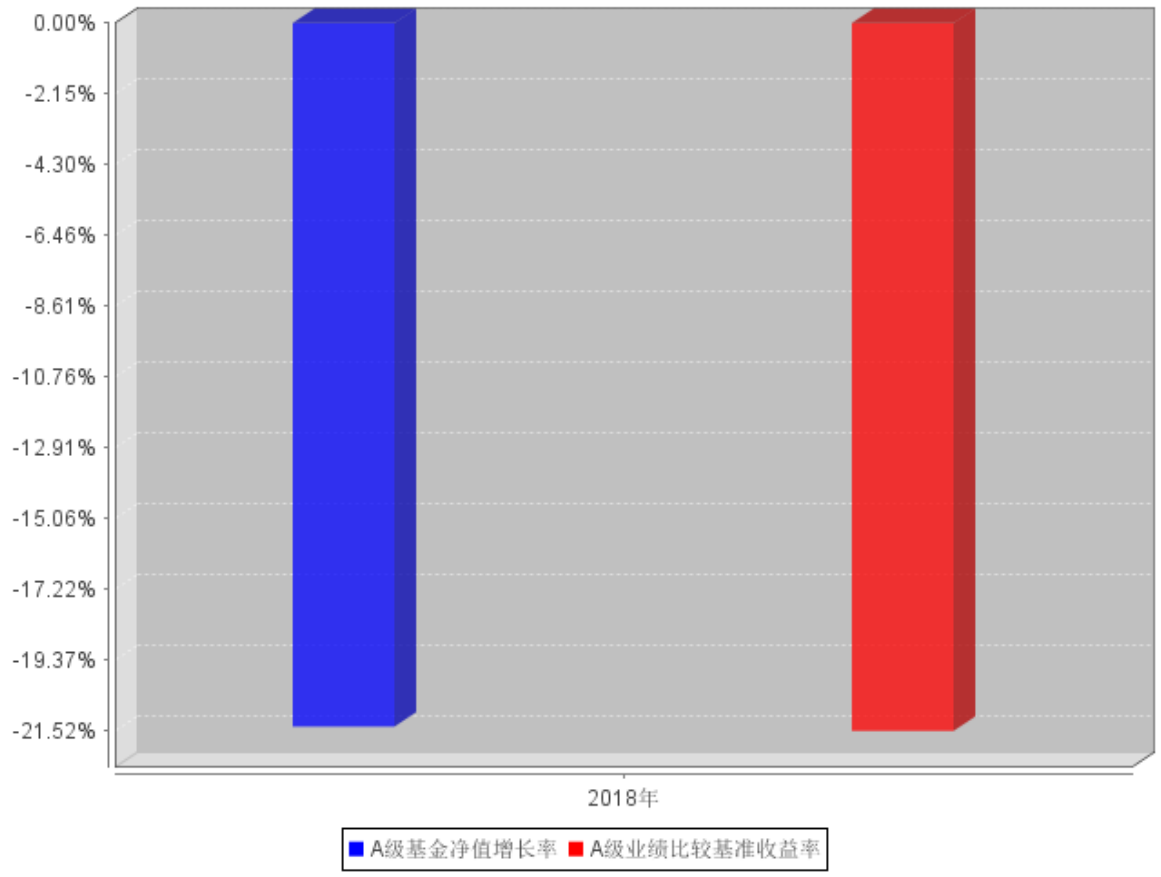


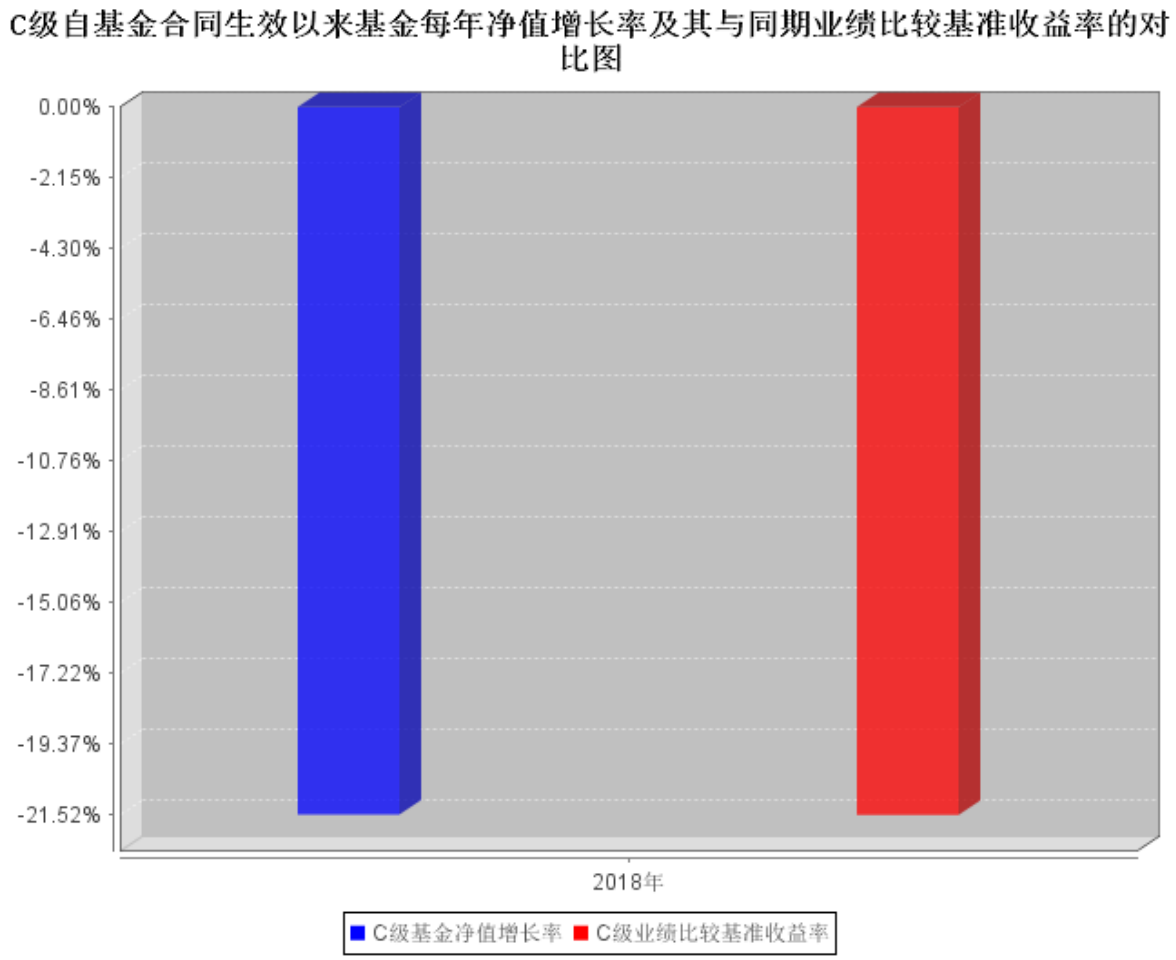

注：1、本基金基金合同于 2018 年 1 月 19 日生效，截至报告期末未满一年。

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，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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图






注：本基金成立于 2018 年 1 月 19 日，2018 年度净值增长率的计算期间为 2018 年 1 月 19 日至 2018 年 12 月 31 日。

## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日(2018 年 1 月 19 日)至报告期截止日(2018 年 12 月 31 日)未进行利润分配。

# §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”或“公司”)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。截至 2018 年 12 月 31 日，泰康资产总规模超过 14000 亿元。除管理泰康委托资产外，泰康资产第三方业务总规模突破 7500 亿元，另类投资管理规模超过 3000 亿元，退休金管理规模超过 2550 亿元。此外，人社部发布的《2018 年三季度全国企业年金基金业务数据摘要》显示，泰康资产管理的企业年金基金组合资产金额达 2112.61 亿元，市场规模排名第一.泰康资产具有丰富的多领域资产配置经验，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外投资、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、基本养老投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、境外理财产品、QDII（合格境内机构投资者）专户、公募基金产品等。

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 2018 年 12 月 31 日，泰康资产公募业务管理规模突破 416 亿，客户数量超过 190 万，发行成立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和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共二十七只公开募集证券投资基金。

### 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 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|

| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 桂跃强 | 本基金基金经理 | 2018 年 1 月 19 日 | - | 12 | 桂跃强于 2015 年 8 月加入泰康资产，现担任公募事业部股票投资负责人。2007 年 9 月至 2015 年 8 月曾任职于新华基金管理有限责任公司，担任基金管理部副总监。历任新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 8 日至今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 日起至今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 日起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 日起至今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 日起至今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 日至今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 日至今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。 |
| 陈怡 | 本基金基金经理 | 2018 年 1 月 19 日 | - | 7 | 陈怡于 2016 年 5 月加入泰康资产，历任万家基金管理有限公司研究部研究员，平安养老保险股份有限公司权益投资部研究员、行业投资经理。2017 年 4 月 19 日至今任泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 10 月 13 日至今任泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 9 日至今任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 28 日至今任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 1 月 19 日至今任泰康均衡优选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。 |

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的披露日期。

## 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《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了公平交易制度和流程，并按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的相关规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源，保证各投资组合获得公平的交易机会。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

2018 年，宏观经济平稳运行，边际上小幅走弱，地产和制造业投资、出口全年来看形成支撑，但融资增速下行、消费放缓、外部因素都对经济形成制约。具体来看，投资端受地方政府控隐性债务的影响，基建投资下行，但房地产和制造业投资则有所上行；消费受到居民收入下行、消费意愿边际趋弱的影响，呈现下行的趋势；出口得以于全球经济复苏，表现较佳。物价方面，CPI 表现平稳，PPI 冲高后有所回落。社融增速受限于结构性去杠杆而有所下行，汇率在贬值之后趋于稳定。

权益市场方面，受中美贸易摩擦，国内信用紧缩且宽货币政策传导不畅影响，进出口数据双双走弱，经济下行压力明显，市场避险情绪升温，在此基础上，市场呈现明显的震荡下跌趋势。上证综指下跌 24.59%，沪深 300 下跌 25.31%，中小板指下跌 37.75%，创业板指下跌 28.65%。从行业来看，餐饮旅游、食品饮料、银行、石油石化等板块表现相对较好，综合、电子、有色等行业表现不佳。

权益投资方面，本基金开局延续了低估值蓝筹的配置，聚焦优质公司，保持并适时增配家电、医药行业。自 3 月份起，在中美贸易摩擦和去杠杆的双重压力下，中国经济数据持续低于预期，配置转为谨慎，逐渐向防御和真成长倾斜，关注并精选各细分子行业中资质优异的成长股。主要配置食品饮料、医药生物、纺织服装等板块，维持相对中性的仓位，等待获取绝对收益更好的时机。进入四季度我们适当增加了高股息和公用事业类等防御性板块的配置，此后将根据市场相机抉择，适时增加组合的进攻性，以自下而上精选个股为主，为明年的布局做好准备。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康均衡优选 A 基金份额净值为 0.7861 元,本报告期基金份额净值增长率为-21.39%;截至本报告期末泰康均衡优选 C 基金份额净值为 0.7849 元,本报告期基金份额净值增长率为-21.51%；同期业绩比较基准增长率为-21.52%。

## 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，基本面下行的压力仍在。地方专项债的放量和提前发行，有望对社融形成支撑，社融增速有望低位企稳，但大幅反弹的难度较大；投资上基建投资有望反弹，与地产投资的潜在下行形成对冲；出口部门受到国际经济下行和贸易战的影响，不确定性较大。政策上，流动性合理充裕的货币政策思路仍将延续，财政政策也正在发力，政策是恪守底线的对冲。

权益市场方面，在经历了 2018 年的大幅下跌之后，我们认为市场将会经历流动性驱动的估值修复行情，但市场的波动性将会加大。主要理由如下：一，截止 2018 年年底，A 股的股权风险溢

价接近历史最高水平，从大类资产对比上看，权益市场已经进入价值投资区间；二，国内经济整体还处于下行趋势，政策上总体还将维持较为宽松的环境，有利于估值修复；三，本轮经济可加杠杆的空间弱于前几轮放松周期，因此基本面回暖的时点并不明确；四，中美贸易谈判以及美联储货币政策仍存在变数。操作方面将在精选个股的基础上适度参与 A 股估值修复过程中各行业轮动的投资机会，在泡沫过于严重时适时离场。

我们将紧密跟踪经济和市场的动态变化，力争把握机会、规避风险，为基金持有人取得较好回报。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：

本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，定期与不定期地对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；建立可供投资的基础库和禁投库，并适时对个券进行维护更新，通过信息技术建立完善投资交易监控系统；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；内部监察稽核人员日常对基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司公募业务风险控制委员会。

## 4.7 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。

## 4.8 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 2018 年 1 月 19 日(基

金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日本基金未进行利润分配。

## 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期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基金资产净值低于五千万元的情形。

# §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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# §6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

| | |
|---|---|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2019)第 22127 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 |
|---|---|
| 审计报告收件人 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | (一)我们审计的内容<br>我们审计了泰康均衡优选混合型证券投资基金(以下简称“泰康均衡优选混合基金”)的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。<br>(二)我们的意见<br>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了泰康均衡优选混合基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。<br>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰康均衡优选混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。 |
| 强调事项 | 无。 |
| 其他事项 | 无。 |
| 其他信息 | 无。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 泰康均衡优选混合基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰康均衡优选混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运 |

| | |
|---|---|
| | 用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰康均衡优选混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。<br>基金管理人治理层负责监督泰康均衡优选混合基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。<br>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：<br>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。<br>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。<br>（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。<br>（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰康均衡优选混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰康均衡优选混合基金不能持续经营。<br>（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价 |

| | | |
|---|---|---|
| | 财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 | |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | |
| 注册会计师的姓名 | 张勇 | 周祎 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼 | |
| 审计报告日期 | 2019 年 3 月 25 日 | |

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：泰康均衡优选混合型证券投资基金

报告截止日： 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| **资 产：** | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 39,257,226.69 |
| 结算备付金 | | 3,134,773.46 |
| 存出保证金 | | 142,288.16 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 487,323,621.86 |
| 其中：股票投资 | | 445,877,186.28 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 41,446,435.58 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - |
| 应收证券清算款 | | 1,529,417.60 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 910,946.75 |
| 应收股利 | | 10,505.60 |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 532,308,780.12 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2018 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付证券清算款 | | 1,251,928.49 |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 690,964.72 |
| 应付托管费 | | 92,128.63 |
| 应付销售服务费 | | 23.56 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 74,516.48 |
| 应交税费 | | 4.13 |
| 应付利息 | | - |

| | | |
|---|---|---|
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 74,000.00 |
| 负债合计 | | 2,183,566.01 |
| **所有者权益：** | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 674,343,532.22 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -144,218,318.11 |
| 所有者权益合计 | | 530,125,214.11 |
| 负债和所有者权益总计 | | 532,308,780.12 |

注：本基金合同生效日为 2018 年 1 月 19 日，本报告期自基金合同生效日 2018 年 1 月 19 日起至 2018 年 12 月 31 日止，报告截止日 2018 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 0.7861 元，C 类基金份额净值 0.7849 元；基金份额总额 674,343,532.22 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 674,340,556.28 份，C 类基金份额总额 2,975.94 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰康均衡优选混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| **一、收入** | | -138,916,635.38 |
| 1.利息收入 | | 3,037,880.57 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 334,296.92 |
| 债券利息收入 | | 763,546.88 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,940,036.77 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -60,297,826.58 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -67,767,564.63 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 65,114.29 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.2 | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 7,404,623.76 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -81,861,005.93 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 204,316.56 |
| **减：二、费用** | | 13,004,842.71 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 9,526,270.61 |

| | | |
|---|---|---|
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 1,270,169.47 |
| 3．销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 401.60 |
| 4．交易费用 | 7.4.7.19 | 1,819,818.52 |
| 5．利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6．税金及附加 | | 1.33 |
| 7．其他费用 | 7.4.7.20 | 388,181.18 |
| **三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）** | | -151,921,478.09 |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | -151,921,478.09 |

注：本基金合同生效日为 2018 年 1 月 19 日，本期是指自基金合同生效日 2018 年 1 月 19 日至 2018 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比期间数据。

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康均衡优选混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 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） | 763,574,183.72 | - | 763,574,183.72 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -151,921,478.09 | -151,921,478.09 |
| 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） | -89,230,651.50 | 7,703,159.98 | -81,527,491.52 |
| 其中：1.基金申购款 | 34,899,048.94 | -1,001,693.91 | 33,897,355.03 |
| 2.基金赎回款 | -124,129,700.44 | 8,704,853.89 | -115,424,846.55 |
| 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） | 674,343,532.22 | -144,218,318.11 | 530,125,214.11 |

注：本基金合同生效日为 2018 年 1 月 19 日，本期是指自基金合同生效日 2018 年 1 月 19 日至 2018 年 12 月 31 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 7.1 至 7.4 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 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰康均衡优选混合型证券投资基金(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[2017]2156 号《关于准予泰康均衡优选混合型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《泰康均衡优选混合型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 763,285,115.04 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0051 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康均衡优选混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 763,574,183.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 289,068.68 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，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《泰康均衡优选混合型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《泰康均衡优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、股指期货、国债期货、债券资产（包括国债、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、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、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、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他

金融工具。投资组合比例为：股票资产占基金资产比例为 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；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合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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：沪深 300 指数收益率*75%+中债新综合财富（总值）指数收益率 x20%+金融机构人民币活期存款利率（税后）x5%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司于 2019 年 3 月 25 日批准报出。

### 7.4.2 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》、《泰康均衡优选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 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。

#### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

### 7.4.4.9 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。

### 7.4.4.10 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。

### 7.4.4.11 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为两种：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。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的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。

### 7.4.4.12 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。

### 7.4.4.13 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) 于 2017 年 12 月 28 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 28 日起，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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 39,257,226.69 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 39,257,226.69 |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 528,083,087.79 | 445,877,186.28 | -82,205,901.51 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 1,419,100.00 | 1,450,435.58 | 31,335.58 |
| | 银行间市场 | 39,682,440.00 | 39,996,000.00 | 313,560.00 |
| | 合计 | 41,101,540.00 | 41,446,435.58 | 344,895.58 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 569,184,627.79 | 487,323,621.86 | -81,861,005.93 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 应收活期存款利息 | 3,658.09 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 743.75 |
| 应收债券利息 | 906,481.61 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 0.02 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 63.28 |
| 合计 | 910,946.75 |

### 7.4.7.6 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 74,516.48 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 74,516.48 |

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 74,000.00 |
| 合计 | 74,000.00 |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 泰康均衡优选混合 A | | |
|---|---|---|
| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 763,574,183.72 | 763,574,183.72 |
| 本期申购 | 34,498,141.37 | 34,498,141.37 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -123,731,768.81 | -123,731,768.81 |
| 本期末 | 674,340,556.28 | 674,340,556.28 |

金额单位：人民币元

| 泰康均衡优选混合 C | | |
|---|---|---|
| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | - | - |
| 本期申购 | 400,907.57 | 400,907.57 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -397,931.63 | -397,931.63 |
| 本期末 | 2,975.94 | 2,975.94 |

注：1. 申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2017 年 12 月 21 日至 2018 年 1 月 12 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人

民币 763,285,115.04 元,全部为认购 A 类基金金额。根据《泰康均衡优选混合型证券投资基金招募说明书》和《泰康均衡优选混合型证券投资基金基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购 A 类基金资金产生的利息收入人民币 289,068.68 元在本基金成立后,折算为 289,068.68 份 A 类基金份额，划入基金份额持有人账户。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 泰康均衡优选混合 A | | | |
|---|---|---|---|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | -70,046,279.76 | -81,867,454.26 | -151,913,734.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,742,698.70 | 3,953,357.26 | 7,696,055.96 |
| 其中：基金申购款 | -1,224,040.08 | 278,753.74 | -945,286.34 |
| 基金赎回款 | 4,966,738.78 | 3,674,603.52 | 8,641,342.30 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -66,303,581.06 | -77,914,097.00 | -144,217,678.06 |

单位：人民币元

| 泰康均衡优选混合 C | | | |
|---|---|---|---|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | -14,192.40 | 6,448.33 | -7,744.07 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 13,978.71 | -6,874.69 | 7,104.02 |
| 其中：基金申购款 | -5,572.86 | -50,834.71 | -56,407.57 |
| 基金赎回款 | 19,551.57 | 43,960.02 | 63,511.59 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -213.69 | -426.36 | -640.05 |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 217,673.47 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 112,222.55 |
| 其他 | 4,400.90 |
| 合计 | 334,296.92 |

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)<br>至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 776,717,422.42 |
| 减：卖出股票成本总额 | 844,484,987.05 |
| 买卖股票差价收入 | -67,767,564.63 |

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018年1月19日(基金合同生效日)至<br>2018年12月31日 |
|---|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 807,270.74 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 742,000.00 |
| 减：应收利息总额 | 156.45 |
| 买卖债券差价收入 | 65,114.29 |

#### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本报告期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日，本基金无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日，本基金无贵金属投资收益。

### 7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日，本基金无衍生工具收益。

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 7,404,623.76 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 7,404,623.76 |

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -81,861,005.93 |
| ——股票投资 | -82,205,901.51 |
| ——债券投资 | 344,895.58 |
| ——资产支持证券投资 | 0 |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | 0 |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | -81,861,005.93 |

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 192,906.90 |
| 基金转换费收入 | 11,409.66 |
| 合计 | 204,316.56 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中：申购费补差收取具体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 1,819,568.52 |
| 银行间市场交易费用 | 250.00 |
| 合计 | 1,819,818.52 |

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---|---|

| | 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 65,000.00 |
| 信息披露费 | 285,300.00 |
| 其他 | 1,100.00 |
| 银行费用 | 5,281.18 |
| 债券帐户维护费 | 31,500.00 |
| 合计 | 388,181.18 |

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 招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 | 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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 9,526,270.61 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,502,700.45 |

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 1.50%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 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,270,169.47 |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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<br>2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰康均衡优选混合 A | 泰康均衡优选混合 C | 合计 |
| 泰康资产管理有限责任公司 | - | 401.60 | 401.60 |
| 合计 | - | 401.60 | 401.60 |

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 0.50%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 0.50% / 当年天数。

### 7.4.10.3 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 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 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。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期 2018 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.4.2 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，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

### 7.4.10.5 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 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 39,257,226.69 | 217,673.47 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

本报告期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日，本基金无利润分配。

### 7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 601860 | 紫金银行 | 2018 年 12 月 20 日 | 2019 年 1 月 3 日 | 网下新股流通受限 | 3.14 | 3.14 | 15,970 | 50,145.80 | 50,145.80 | - |
| 601138 | 工业富联 | 2018 年 5 月 28 日 | 2019 年 6 月 10 日 | 新股锁定期流通受限 | 13.77 | 10.97 | 309,349 | 4,259,735.73 | 3,393,558.53 | - |

| 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 110049 | 海尔 | 2018 年 | 2019 | 老股配 | 100.00 | 100.00 | 2,740 | 274,000.00 | 274,000.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 转债 | 12 月 18 日 | 年 1 月 18 日 | 债流通受限 | | | | | | |
| 110049 | 海尔转债 | 2018 年 12 月 20 日 | 2019 年 1 月 18 日 | 网下新债流通受限 | 100.00 | 100.00 | 5,890 | 589,000.00 | 589,000.00 | - |

注：基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600030 | 中信证券 | 2018 年 12 月 25 日 | 重大事项停牌 | 16.01 | 2019 年 1 月 10 日 | 17.15 | 1,264,700 | 22,215,861.00 | 20,247,847.00 | - |

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，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。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，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。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制订了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| A-1 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债等。

### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| A-1 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| A-1 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| AAA | 1,253,165.00 |
| AAA 以下 | 197,270.58 |
| 未评级 | 0.00 |
| 合计 | 1,450,435.58 |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债等。

### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| AAA | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 |

| | |
|---|---|
| 未评级 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| AAA | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 12 月 31 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化 。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及资产支持证券投资等。

### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 39,257,226.69 | - | - | - | 39,257,226.69 |
| 结算备付金 | 3,134,773.46 | - | - | - | 3,134,773.46 |
| 存出保证金 | 142,288.16 | - | - | - | 142,288.16 |
| 交易性金融资产 | 39,996,000.00 | 1,990.00 | 1,448,445.58 | 445,877,186.28 | 487,323,621.86 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,529,417.60 | 1,529,417.60 |
| 应收利息 | - | - | - | 910,946.75 | 910,946.75 |
| 应收股利 | - | - | - | 10,505.60 | 10,505.60 |
| 资产总计 | 82,530,288.31 | 1,990.00 | 1,448,445.58 | 448,328,056.23 | 532,308,780.12 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,251,928.49 | 1,251,928.49 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 690,964.72 | 690,964.72 |
| 应付托管费 | - | - | - | 92,128.63 | 92,128.63 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 23.56 | 23.56 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 74,516.48 | 74,516.48 |
| 应交税费 | - | - | - | 4.13 | 4.13 |
| 其他负债 | - | - | - | 74,000.00 | 74,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,183,566.01 | 2,183,566.01 |
| 利率敏感度缺口 | 82,530,288.31 | 1,990.00 | 1,448,445.58 | 446,144,490.22 | 530,125,214.11 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响 | |
|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
| | | 本期末（ 2018 年 12 月 31 日 ） |
| | 市场利率下调 0.25% | 38,527.42 |
| | 市场利率上调 0.25% | -38,164.47 |

### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 72913662.00 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 72913662.00 元。假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 729136.62 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-729136.62 元。

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；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合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%；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。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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|

| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 交易性金融资产-股票投资 | 445,877,186.28 | 84.11 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | - | - |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 445,877,186.28 | 84.11 |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

### 7.4.14 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 2018 年 12 月 31 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 422,185,634.95 元，属于第二层次的余额为 65,137,986.91 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 2018 年 12 月 31 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。

# §8 投资组合报告

## 8.1 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 | 445,877,186.28 | 83.76 |
| | 其中：股票 | 445,877,186.28 | 83.76 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 41,446,435.58 | 7.79 |
| | 其中：债券 | 41,446,435.58 | 7.79 |
| | 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 | 42,392,000.15 | 7.96 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,593,158.11 | 0.49 |
| 9 | 合计 | 532,308,780.12 | 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 72,913,662.00 元，占期末资产净值比例为 13.75%。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 8,507,030.00 | 1.60 |
| B | 采矿业 | 7,216,917.00 | 1.36 |
| C | 制造业 | 241,462,814.31 | 45.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,836,795.88 | 1.48 |
| E | 建筑业 | 2,967,742.80 | 0.56 |
| F | 批发和零售业 | 2,220,931.05 | 0.42 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,529,656.17 | 1.42 |
| H | 住宿和餐饮业 | 957.60 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 10,223,159.95 | 1.93 |
| J | 金融业 | 45,965,449.80 | 8.67 |
| K | 房地产业 | 21,519,129.23 | 4.06 |
| L | 租赁和商务服务业 | 57.64 | 0.00 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 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 | 9,381,020.35 | 1.77 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,131,862.50 | 1.53 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 372,963,524.28 | 70.35 |

### 8.2.2 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 | 19,258,900.00 | 3.63 |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | 23,158,808.00 | 4.37 |
| F 医疗保健 | 1,490,080.00 | 0.28 |
| G 工业 | 4,343,450.00 | 0.82 |
| H 信息技术 | 20,000,424.00 | 3.77 |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | 4,662,000.00 | 0.88 |
| 合计 | 72,913,662.00 | 13.75 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 600519 | 贵州茅台 | 56,266 | 33,197,502.66 | 6.26 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 1,264,700 | 20,247,847.00 | 3.82 |
| 2 | 06030 | 中信证券 | 108,000 | 1,277,640.00 | 0.24 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 928,700 | 21,248,656.00 | 4.01 |
| 4 | 00268 | 金蝶国际 | 3,300,400 | 20,000,424.00 | 3.77 |
| 5 | 000002 | 万　科Ａ | 799,001 | 19,032,203.82 | 3.59 |
| 6 | 01169 | 海尔电器 | 1,100,000 | 18,568,000.00 | 3.50 |
| 7 | 000651 | 格力电器 | 480,223 | 17,139,158.87 | 3.23 |
| 8 | 300630 | 普利制药 | 357,824 | 15,765,725.44 | 2.97 |
| 9 | 01398 | 工商银行 | 2,030,000 | 9,947,000.00 | 1.88 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 685,500 | 3,626,295.00 | 0.68 |
| 10 | 300408 | 三环集团 | 688,500 | 11,649,420.00 | 2.20 |
| 11 | 603288 | 海天味业 | 138,486 | 9,527,836.80 | 1.80 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 12 | 002044 | 美年健康 | 627,493 | 9,381,020.35 | 1.77 |
| 13 | 600276 | 恒瑞医药 | 157,569 | 8,311,764.75 | 1.57 |
| 14 | 300258 | 精锻科技 | 679,007 | 8,304,255.61 | 1.57 |
| 15 | 601098 | 中南传媒 | 650,549 | 8,131,862.50 | 1.53 |
| 16 | 002179 | 中航光电 | 235,869 | 7,944,067.92 | 1.50 |
| 17 | 600900 | 长江电力 | 493,501 | 7,836,795.88 | 1.48 |
| 18 | 600690 | 青岛海尔 | 556,200 | 7,703,370.00 | 1.45 |
| 19 | 600079 | 人福医药 | 751,300 | 7,618,182.00 | 1.44 |
| 20 | 601688 | 华泰证券 | 454,500 | 7,362,900.00 | 1.39 |
| 21 | 600660 | 福耀玻璃 | 322,500 | 7,346,550.00 | 1.39 |
| 22 | 300702 | 天宇股份 | 314,667 | 6,875,473.95 | 1.30 |
| 23 | 600486 | 扬农化工 | 177,600 | 6,688,416.00 | 1.26 |
| 24 | 000895 | 双汇发展 | 271,200 | 6,397,608.00 | 1.21 |
| 25 | 600547 | 山东黄金 | 203,700 | 6,161,925.00 | 1.16 |
| 26 | 600498 | 烽火通信 | 197,450 | 5,621,401.50 | 1.06 |
| 27 | 601166 | 兴业银行 | 370,500 | 5,535,270.00 | 1.04 |
| 28 | 002402 | 和而泰 | 855,200 | 5,285,136.00 | 1.00 |
| 29 | 601288 | 农业银行 | 1,425,200 | 5,130,720.00 | 0.97 |
| 30 | 300498 | 温氏股份 | 183,500 | 4,804,030.00 | 0.91 |
| 31 | 02202 | 万科企业 | 200,000 | 4,662,000.00 | 0.88 |
| 32 | 002773 | 康弘药业 | 135,400 | 4,613,078.00 | 0.87 |
| 33 | 600406 | 国电南瑞 | 248,015 | 4,595,717.95 | 0.87 |
| 34 | 603538 | 美诺华 | 229,140 | 4,511,766.60 | 0.85 |
| 35 | 03908 | 中金公司 | 316,800 | 4,080,384.00 | 0.77 |
| 36 | 601318 | 中国平安 | 71,520 | 4,012,272.00 | 0.76 |
| 37 | 002563 | 森马服饰 | 436,800 | 3,896,256.00 | 0.73 |
| 38 | 002714 | 牧原股份 | 128,800 | 3,703,000.00 | 0.70 |
| 39 | 000661 | 长春高新 | 19,857 | 3,474,975.00 | 0.66 |
| 40 | 601138 | 工业富联 | 309,349 | 3,393,558.53 | 0.64 |
| 41 | 603037 | 凯众股份 | 188,561 | 3,375,241.90 | 0.64 |
| 42 | 600570 | 恒生电子 | 64,100 | 3,331,918.00 | 0.63 |
| 43 | 002048 | 宁波华翔 | 310,247 | 3,235,876.21 | 0.61 |
| 44 | 000333 | 美的集团 | 87,600 | 3,228,936.00 | 0.61 |
| 45 | 002081 | 金 螳 螂 | 366,388 | 2,967,742.80 | 0.56 |
| 46 | 002223 | 鱼跃医疗 | 141,800 | 2,780,698.00 | 0.52 |
| 47 | 01336 | 新华保险 | 102,000 | 2,779,500.00 | 0.52 |
| 48 | 603788 | 宁波高发 | 182,161 | 2,632,226.45 | 0.50 |
| 49 | 02357 | 中航科工 | 599,000 | 2,581,690.00 | 0.49 |
| 50 | 601799 | 星宇股份 | 52,405 | 2,489,237.50 | 0.47 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 51 | 600622 | 光大嘉宝 | 438,603 | 2,486,879.01 | 0.47 |
| 52 | 000429 | 粤高速A | 296,103 | 2,484,304.17 | 0.47 |
| 53 | 002304 | 洋河股份 | 23,800 | 2,254,336.00 | 0.43 |
| 54 | 02601 | 中国太保 | 100,000 | 2,221,000.00 | 0.42 |
| 55 | 600029 | 南方航空 | 317,400 | 2,107,536.00 | 0.40 |
| 56 | 600529 | 山东药玻 | 108,600 | 2,063,400.00 | 0.39 |
| 57 | 002029 | 七 匹 狼 | 319,700 | 1,982,140.00 | 0.37 |
| 58 | 000739 | 普洛药业 | 248,900 | 1,851,816.00 | 0.35 |
| 59 | 00694 | 北京首都机场股份 | 242,000 | 1,761,760.00 | 0.33 |
| 60 | 002311 | 海大集团 | 72,000 | 1,668,240.00 | 0.31 |
| 61 | 600377 | 宁沪高速 | 156,800 | 1,536,640.00 | 0.29 |
| 62 | 000729 | 燕京啤酒 | 267,800 | 1,510,392.00 | 0.28 |
| 63 | 01066 | 威高股份 | 268,000 | 1,490,080.00 | 0.28 |
| 64 | 06886 | HTSC | 136,400 | 1,481,304.00 | 0.28 |
| 65 | 601111 | 中国国航 | 183,400 | 1,401,176.00 | 0.26 |
| 66 | 01658 | 邮储银行 | 379,000 | 1,371,980.00 | 0.26 |
| 67 | 300253 | 卫宁健康 | 109,100 | 1,359,386.00 | 0.26 |
| 68 | 300642 | 透景生命 | 31,950 | 1,209,627.00 | 0.23 |
| 69 | 000028 | 国药一致 | 26,800 | 1,110,592.00 | 0.21 |
| 70 | 603883 | 老百姓 | 23,500 | 1,109,435.00 | 0.21 |
| 71 | 601225 | 陕西煤业 | 141,800 | 1,054,992.00 | 0.20 |
| 72 | 300188 | 美亚柏科 | 71,900 | 936,138.00 | 0.18 |
| 73 | 002332 | 仙琚制药 | 145,552 | 892,233.76 | 0.17 |
| 74 | 600584 | 长电科技 | 103,000 | 848,720.00 | 0.16 |
| 75 | 300285 | 国瓷材料 | 44,000 | 733,480.00 | 0.14 |
| 76 | 02020 | 安踏体育 | 21,000 | 690,900.00 | 0.13 |
| 77 | 300633 | 开立医疗 | 23,400 | 644,670.00 | 0.12 |
| 78 | 002222 | 福晶科技 | 54,600 | 532,896.00 | 0.10 |
| 79 | 002281 | 光迅科技 | 16,300 | 437,818.00 | 0.08 |
| 80 | 600585 | 海螺水泥 | 12,644 | 370,216.32 | 0.07 |
| 81 | 603008 | 喜临门 | 12,400 | 114,328.00 | 0.02 |
| 82 | 603185 | 上机数控 | 1,345 | 66,039.50 | 0.01 |
| 83 | 601860 | 紫金银行 | 15,970 | 50,145.80 | 0.01 |
| 84 | 600196 | 复星医药 | 1,102 | 25,643.54 | 0.00 |
| 85 | 600258 | 首旅酒店 | 60 | 957.60 | 0.00 |
| 86 | 603708 | 家家悦 | 45 | 904.05 | 0.00 |
| 87 | 002035 | 华帝股份 | 50 | 442.50 | 0.00 |
| 88 | 002027 | 分众传媒 | 11 | 57.64 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 89 | 600208 | 新湖中宝 | 16 | 46.40 | 0.00 |

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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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 | 600887 | 伊利股份 | 63,966,681.48 | 12.07 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 62,379,704.59 | 11.77 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 47,100,877.91 | 8.88 |
| 4 | 00700 | 腾讯控股 | 43,325,272.20 | 8.17 |
| 5 | 002044 | 美年健康 | 37,438,572.42 | 7.06 |
| 6 | 600585 | 海螺水泥 | 33,411,952.43 | 6.30 |
| 7 | 300630 | 普利制药 | 32,601,740.96 | 6.15 |
| 8 | 600276 | 恒瑞医药 | 32,253,751.44 | 6.08 |
| 9 | 000002 | 万　科Ａ | 31,830,772.38 | 6.00 |
| 10 | 01169 | 海尔电器 | 28,004,070.60 | 5.28 |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 24,219,593.00 | 4.57 |
| 12 | 00268 | 金蝶国际 | 22,764,744.00 | 4.29 |
| 13 | 01336 | 新华保险 | 19,236,819.25 | 3.63 |
| 14 | 300408 | 三环集团 | 18,904,844.00 | 3.57 |
| 15 | 603288 | 海天味业 | 17,483,022.78 | 3.30 |
| 16 | 002563 | 森马服饰 | 15,778,809.00 | 2.98 |
| 17 | 600622 | 光大嘉宝 | 15,191,983.24 | 2.87 |
| 18 | 300258 | 精锻科技 | 14,108,297.15 | 2.66 |
| 19 | 600208 | 新湖中宝 | 13,652,926.00 | 2.58 |
| 20 | 601601 | 中国太保 | 13,570,556.26 | 2.56 |
| 21 | 01398 | 工商银行 | 13,131,740.06 | 2.48 |
| 22 | 002179 | 中航光电 | 12,646,981.11 | 2.39 |
| 23 | 600690 | 青岛海尔 | 12,482,938.00 | 2.35 |
| 24 | 002008 | 大族激光 | 11,731,195.20 | 2.21 |
| 25 | 601318 | 中国平安 | 11,485,163.00 | 2.17 |
| 26 | 601398 | 工商银行 | 11,126,183.00 | 2.10 |
| 27 | 300070 | 碧水源 | 11,047,277.00 | 2.08 |

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。

### 8.4.2 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 | 00700 | 腾讯控股 | 39,036,874.07 | 7.36 |
| 2 | 600585 | 海螺水泥 | 31,853,812.20 | 6.01 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 29,766,398.76 | 5.61 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 29,003,727.69 | 5.47 |
| 5 | 600276 | 恒瑞医药 | 26,970,021.64 | 5.09 |
| 6 | 002044 | 美年健康 | 20,028,338.31 | 3.78 |
| 7 | 300630 | 普利制药 | 15,934,810.36 | 3.01 |
| 8 | 002563 | 森马服饰 | 12,756,934.91 | 2.41 |
| 9 | 601601 | 中国太保 | 11,786,844.86 | 2.22 |
| 10 | 603288 | 海天味业 | 11,505,372.19 | 2.17 |
| 11 | 01336 | 新华保险 | 11,404,973.12 | 2.15 |
| 12 | 300070 | 碧水源 | 9,762,888.77 | 1.84 |
| 13 | 00268 | 金蝶国际 | 9,545,091.54 | 1.80 |
| 14 | 600352 | 浙江龙盛 | 9,031,985.28 | 1.70 |
| 15 | 300601 | 康泰生物 | 9,001,004.77 | 1.70 |
| 16 | 600208 | 新湖中宝 | 8,826,688.56 | 1.67 |
| 17 | 002008 | 大族激光 | 8,685,395.17 | 1.64 |
| 18 | 600138 | 中青旅 | 8,058,924.72 | 1.52 |
| 19 | 002027 | 分众传媒 | 8,038,294.00 | 1.52 |
| 20 | 600258 | 首旅酒店 | 8,017,469.45 | 1.51 |

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。

### 8.4.3 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 | 1,372,568,074.84 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 776,717,422.42 |

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。

## 8.5 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 39,996,000.00 | 7.54 |
| | 其中：政策性金融债 | 39,996,000.00 | 7.54 |
| 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） | 1,450,435.58 | 0.27 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 41,446,435.58 | 7.82 |

## 8.6 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 | 160208 | 16 国开 08 | 400,000 | 39,996,000.00 | 7.54 |
| 2 | 110049 | 海尔转债 | 8,630 | 863,000.00 | 0.16 |
| 3 | 128045 | 机电转债 | 3,700 | 390,165.00 | 0.07 |
| 4 | 128047 | 光电转债 | 1,821 | 193,353.78 | 0.04 |
| 5 | 113019 | 玲珑转债 | 20 | 1,990.00 | 0.00 |

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 8.12.2 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未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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 | 142,288.16 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,529,417.60 |
| 3 | 应收股利 | 10,505.60 |
| 4 | 应收利息 | 910,946.75 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,593,158.11 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113019 | 玲珑转债 | 1,990.00 | 0.00 |
| 2 | 113508 | 新凤转债 | 1,926.80 | 0.00 |

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600030 | 中信证券 | 20,247,847.00 | 3.82 | 重大事项停牌 |

### 8.12.6 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。

# §9 基金份额持有人信息

## 9.1 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 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 泰康均衡优选混合 A | 6,581 | 102,467.79 | 0.00 | 0.00% | 674,340,556.28 | 100.00% |
| 泰康均衡优选混合 C | 2 | 1,487.97 | 0.00 | 0.00% | 2,975.94 | 100.00% |
| 合计 | 6,583 | 102,437.12 | 0.00 | 0.00% | 674,343,532.22 | 100.00% |

## 9.2 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 | 泰康均衡优选混合 A | 2,777,941.25 | 0.4119% |
| | 泰康均衡优选混合 C | 2,363.12 | 79.4075% |
| | 合计 | 2,780,304.37 | 0.4123% |

## 9.3 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 | 泰康均衡优选混合 A | >100 |
| | 泰康均衡优选混合 C | 0 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 泰康均衡优选混合 A | >100 |
| | 泰康均衡优选混合 C | 0 |
| | 合计 | >100 |

# §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 泰康均衡优选混合<br>A | 泰康均衡优选混合<br>C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2018 年 1 月 19 日）基金份额总额 | 763,574,183.72 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 34,498,141.37 | 400,907.57 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 123,731,768.81 | 397,931.63 |
| 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 | 674,340,556.28 | 2,975.94 |

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。

# §11 重大事件揭示

## 11.1 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。

## 11.2 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未出现重大人事变动。

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

## 11.3 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。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内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，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 65,000.00 元；截至 2018 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 1 年。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 招商证券 | 2 | 477,220,347.94 | 22.29% | 125,632.34 | 20.75% | - |
| 中金公司 | 2 | 425,643,667.05 | 19.89% | 125,253.82 | 20.69% | - |
| 方正证券 | 2 | 383,209,956.54 | 17.90% | 108,592.26 | 17.94% | - |
| 申万宏源证券 | 2 | 279,138,256.05 | 13.04% | 84,227.38 | 13.91% | - |
| 光大证券 | 2 | 167,456,570.97 | 7.82% | 47,473.83 | 7.84% | - |
| 兴业证券 | 2 | 137,118,797.13 | 6.41% | 39,042.93 | 6.45% | - |
| 东方证券 | 2 | 134,350,353.10 | 6.28% | 38,976.35 | 6.44% | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 广发证券 | 2 | 112,092,460.66 | 5.24% | 29,444.58 | 4.86% | - |
| 海通证券 | 2 | 24,260,711.04 | 1.13% | 6,791.57 | 1.12% | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 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、保监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，并根据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 26 个交易单元，分别为中金公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，广发证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，兴业证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，方正证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，申万宏源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东吴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，天风证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，招商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，海通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

### 11.7.2 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 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 招商证券 | 667,946.74 | 82.74% | - | - | - | - |
| 中金公司 | 139,324.00 | 17.26% | 500,000,000.00 | 4.49% | - | - |
| 方正证券 | - | - | 3,843,600,000.00 | 34.48% | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | 3,948,700,000.00 | 35.42% | - | - |
| 光大证券 | - | - | 1,525,200,000.00 | 13.68% | - | - |
| 兴业证券 | - | - | 1,330,000,000.00 | 11.93% | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |

## 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金基金合同生效公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 1 月 20 日 |
| 2 | 泰康资产管理有限责任公司关于调整大泰金石基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 2 月 2 日 |
| 3 | 泰康资产管理有限责任公司关于调整上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 2 月 28 日 |
| 4 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 4 月 3 日 |
| 5 | 关于泰康均衡优选混合型证券投资基金实施直销电子交易申购（含定期定额投资）费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 4 月 3 日 |
| 6 | 关于泰康均衡优选混合型证券投资基金参加部分销售机构申购、定投及转换费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 4 月 3 日 |
| 7 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金 2018 年“劳动节”期间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 4 月 24 日 |
| 8 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金 2018 年“香港佛诞日”期间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 5 月 19 日 |
| 9 | 泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金在招商银行股份有限公司定期定额投资金额下限的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 5 月 22 日 |
| 10 | 泰康资产管理有限责任公司关于调整中国银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 5 月 28 日 |
| 11 | 泰康资产管理有限责任公司 | 《中国证券报》、《上 | 2018 年 5 月 30 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 关于直销电子交易部分平台开通预约交易业务的公告 | 海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | |
| 12 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金 2018 年“香港特别行政区成立纪念日翌日”期间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 6 月 29 日 |
| 13 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加奕丰金融服务（深圳）有限公司费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 7 月 23 日 |
| 14 | 泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下开放式基金在泰诚财富基金销售（大连）有限公司申购金额下限的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 7 月 23 日 |
| 15 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 7 月 25 日 |
| 16 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加上海攀赢基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 8 月 24 日 |
| 17 | 泰康资产管理有限责任公司关于旗下基金估值调整情况的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 8 月 28 日 |
| 18 | 关于提请投资者及时补充、更新账户信息资料并接受或重新接受风险承受能力评估的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 9 月 14 日 |
| 19 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金 2018 年“中秋节”期间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 9 月 18 日 |
| 20 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 9 月 21 日 |
| 21 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金 2018 年“国庆节”期 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时 | 2018 年 9 月 25 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 报》及基金管理人网站 | |
| 22 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 10 月 12 日 |
| 23 | 泰康资产管理有限责任公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 10 月 12 日 |
| 24 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金 2018 年“重阳节”期间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 10 月 15 日 |
| 25 | 泰康资产管理有限责任公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 10 月 16 日 |
| 26 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 10 月 19 日 |
| 27 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加中信建投证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 10 月 26 日 |
| 28 | 关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 10 月 26 日 |
| 29 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金 2018 年“圣诞节”期间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 12 月 21 日 |
| 30 | 泰康均衡优选混合型证券投资基金 2019 年“元旦”期间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站 | 2018 年 12 月 26 日 |

# §12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无 |

# §13 备查文件目录

## 13.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予泰康均衡优选混合型证券投资基金注册的文件；

（二）《泰康均衡优选混合型证券投资基金基金合同》；

（三）《泰康均衡优选混合型证券投资基金招募说明书》；

（四）《泰康均衡优选混合型证券投资基金托管协议》。

## 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

## 13.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《上海证券报》）或登录基金管理人互联网网址（http://www.tkfunds.com.cn）查阅。

泰康资产管理有限责任公司

2019 年 3 月 27 日