

泰康现金管家货币市场基金

2018年第四季度报告

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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月22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法律责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月21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。
本报告期内未发生涉及诉讼、仲裁、行政处罚等事件。
本报告期为2018年10月1日起至2018年12月31日止。

基金名称	
泰康现金管家货币	
交易代码	004061
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2017年9月16日
报告期末基金份额总额	2,292,000,185.27份
投资目标	在符合法律法规的前提下,通过积极主动的投资管理,力争为投资人创造稳定的增值。
投资策略	本基金在分析各类资产的风险、流动性、收益性及其风险调整后收益水平的基础上,通过自上而下和自下而上的资产配置策略,动态调整投资组合,在严格控制风险的前提下,适度提高组合收益水平,实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,低风险品种,其预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基本情况	下属分级基金的交易代码 报告期末下属分级基金的份额总额
泰康现金管家货币A	004061 44,476,411.02份
泰康现金管家货币B	004062 349,288,132.60份
泰康现金管家货币C	004063 1,909,239,631.65份
泰康现金管家货币D	004064 -

3.1 主要财务指标		单位:人民币元		
主要财务指标		1.本期已实现收益	2. 本期利润	3. 期末基金份额净值
泰康现金管家货币A		356,236.97	356,236.97	44.476,411.02
泰康现金管家货币B		2,467,544.72	2,467,544.72	349,288,132.60
泰康现金管家货币C		16,246,889.65	16,246,889.65	1,909,239.63
泰康现金管家货币D		-	-	-
报告期末(2018年10月1日至2018年12月31日)				

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(2)本基金未持有从事公允价值变动的金融资产,因此,公允价值变动收益为零。

(3)本基金未发生D类份额赎回。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康现金管家货币A				
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 ②	净值增长率与基准 收益率之差 ③	④-②-③
过去一年	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%
过去三年	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%

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		0.0000%	0.0000%	0.0400%	0.0000%	0.0600	0.0000
过去一年		0.0000%	0.0000%	0.0400%	0.0000%	0.0600	0.0000
注:本基金收益分配按日结转份额。							

基金管理人:泰康资产管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月22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法律责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月21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。
本报告期内未发生涉及诉讼、仲裁、行政处罚等事件。
本报告期为2018年10月1日起至2018年12月31日止。

基金名称	
泰康稳健增利债券	
交易代码	002046
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年12月31日
报告期末基金份额总额	159,022,096.10份
投资目标	本基金在符合法律法规的前提下,力求超越业绩比较基准的增值,力争为基金持有人创造长期稳定的增值。
投资策略	本基金在符合法律法规的前提下,力求超越业绩比较基准的增值,力争为基金持有人创造长期稳定的增值。
业绩比较基准	中债新综合指数(总值)收益率减去0.50%+同期人民币一年期定期存款利率(税后)×75%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于中等风险品种,预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基本情况	下属分级基金的交易代码 报告期末下属分级基金的份额总额
泰康稳健增利债券A	002046 60,226.46
泰康稳健增利债券B	002047 98,795.64
报告期末下属分级基金份额总额	159,022,096.10

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：中国农业银行股份有限公司

报告截止日期：2018年10月22日

3.1 重要提示

基金管理人及基金托管人承诺不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年12月31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，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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，投资存在风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书及其更新。

本基金财务数据未经审计

本报告期为2018年10月1日起至2018年12月31日止。

3.2 基金产品概况

基金简称	泰康稳健增利债券多策略组合
交易代码	005631
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年07月26日
报告期末基金资产总额	282,248,072.02元
投资目标	本基金坚持价值投资，以量化多因子选股策略、价值发现策略、量化资产配置策略为主要策略，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的长期投资回报。
投资策略	本基金采用利益相关者理论，从宏观资源禀赋分析、中上游供应链分析、通过基金管理人自身构建的量化投资选股决策分析系统对股票资产进行选股，重点把握行业景气度、投资逻辑、产能、全球供应链以及行业发展进行行业和价值挖掘。在此基础上，通过定性定量分析来筛选未来成长性良好的标的资产以及市场低估的资产。通过因素、技术驱动经济成长、消费升级驱动资产配置逻辑，挖掘具备成长潜力的优质标的资产，通过量化模型筛选资产，预期获取超额收益，满足资产配置需求。
投资范围	股票投资方面，本基金坚持价值投资，采用科学、合理的量化模型进行选股，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。债券投资方面，本基金根据利率债、信用债、可转债、可转债分离交易可转债、资产支持证券、中期票据、短期融资券、资产支持票据、定向增发

	产,另按公允价值。	
业绩比较基准	中证800指数收益率*90%+中债综合全价指数收益率*10%+金融同业人民币活期存款利率*(税)后) 75%	
风险收益特征	本基金为权益型基金,预期收益和风险水平高于股票型基金,其投资于本基金与货币市场基金	
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰康睿量化多策略混合A	泰康睿量化多策略混合C
下属分级基金的代码	005281	005282
报告期末下属分级基金的资产总额	232,152,209.72元	66,670,074.0元

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	单位:人民币元	
	报告期(2018年10月1日 - 2018年12月31日)	报告期(2018年12月31日)
	泰康睿量化多策略混合A	泰康睿量化多策略混合C
1. 本期已实现收益	-43,160,578.44	-9,238.00
2. 本期利润	-28,244,771.99	-16,127.07
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0690	-0.0830
4. 期末基金资产净值	116,494,961.33	66,726.26

泰

泰康现金管家货币B

阶段	净收益率①	净收益率标准差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	0.7574%	0.0020%	0.3400%	0.0000%	0.4171%	0.0020%

注:本基金收益分配按日结转份额。

泰康现金管家货币C

阶段	净收益率①	净收益率标准差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	0.7574%	0.0020%	0.3400%	0.0000%	0.4171%	0.0020%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Figure 3.2.2: Comparison of cumulative net value yield rate of the fund and benchmark yield rate. The figure consists of three sub-charts, each showing the performance of the fund (泰康现金管家货币B) and its benchmark (业绩比较基准) over a specific period. The x-axis represents time, and the y-axis represents the yield rate. The top chart covers the period from 2017.06.08 to 2017.09.08, the middle chart covers 2017.09.08 to 2017.12.08, and the bottom chart covers 2017.12.08 to 2018.03.08. In all three periods, the fund's yield rate is consistently higher than the benchmark's yield rate, indicating superior performance.

注:1.本基金基金合同于2017年09月08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

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		0.0000%	0.0000%	0.0400%	0.0000%	0.0600	0.0000
过去一年		0.0000%	0.0000%	0.0400%	0.0000%	0.0600	0.0000
注:本基金收益分配按日结转份额。							

基金管理人:泰康资产管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月22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法律责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月21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。
本报告期内未发生涉及诉讼、仲裁、行政处罚等事件。
本报告期为2018年10月1日起至2018年12月31日止。

基金名称	
泰康睿利量化多策略混合	
交易代码	005261
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年12月31日
报告期末基金份额总额	292,240,179.82份
投资目标	本基金在符合法律法规的前提下,力求超越业绩比较基准的增值,力争为基金持有人创造长期稳定的增值。
投资策略	本基金在符合法律法规的前提下,力求超越业绩比较基准的增值,力争为基金持有人创造长期稳定的增值。
业绩比较基准	中债新综合指数(总值)收益率减去0.50%+同期人民币一年期定期存款利率(税后)×75%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金和债券型基金。
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基本情况	下属分级基金的交易代码 报告期末下属分级基金的份额总额
泰康睿利量化多策略混合A	005261 292,240,179.82份
泰康睿利量化多策略混合B	005262 -
报告期末下属分级基金份额总额	292,240,179.82份

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%
前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

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）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 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

3.2.2 本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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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	-12.49%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.65%	0.20%

注：（1）本基金基金合同于2016年12月31日生效，截至报告期末本基金未满一年。

（2）按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定，建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰康睿利量化多策略混合A

前段	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	-12.27%	1.52%	-0.84%	1.32%	-2.57%	0.20%

泰康睿利量化多策略混合C

前段	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					

注:1.本基金基金合同于2016年2月6日生效,截止报告期末本基金未满一年。

2.按照本基金的基金合同约定,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约定的,建仓期结束后本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3. 本基金净值表现
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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
在此期间内本基金业绩为参照泰康睿利量化A类资产的业绩情况进行披露。

5.4 管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理时间	离任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
刘伟	本基金基金经理	2016年2月6日	-	7	刘伟于2013年10月加入泰康资产,历任风险管理部风险管理研究岗、高级风控岗、公募事业部投资金融工程岗、基金运营岗。现任公募事业部投资证券基金化投资岗。2017年6月4日至今任泰康睿利精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康弘润的基金经理及资产配置委员会证券投资基金投资决策委员会成员,多策略基金投资决策委员会成员,多策略基金投资决策委员会成员,2017年7月20日至今担任泰康基金化投资证券基金化投资证券基金化基金基金经理,2018年2月6日至今担任泰康睿利精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年12月21日至今担任泰康睿利精选灵活配置混合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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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,本基金整体运作合法合规,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

现金管家货

2018年第四季度报告

报告期	本基金业绩	2017年7月8日 -	30
<p>南利资产于2006年7月加入泰康资产，历任中国工商银行交易员、招商银行资产管理部交易员、招商银行资产管理部、南京农商汇资产、南京农商汇资产管理部、南京农商</p>			

资产有所下滑,消费延迟下滑通滞,而出口则面临外需增长的担忧。物价方面,CPI保持平稳,但CPI环比增速仍处于下行阶段。金融条件方面,社融增速持续下降,汇率有所升值。

报告期内,四季度宏观经济数据持续下行。整个季度来看,利率下行的趋势较为顺畅,主要是基本面上行压力较大,经济和金融数据都低于预期,带动风险偏好有所回升,同时美联储加息、美债违约风险等也是重要驱动因素。利率较为明显的上行发生在12月中旬,与当时通胀数据超预期、以及美联储加息预期有关,但此后随着预期转弱,利率重回下行通道。本季度来看,10Y国债下行30bp,10Y国债下行56bp。

报告期内,本基金以货币资产、存款、逆回购、短期融资券为主要资产配置资产,保持适度杠杆,并根据市场利率变化,适时调整短期融资券组合平均剩余期限。

4.5 报告期内本基金业绩表现

截至本报告期末泰康现金资产基金净值增长率为0.6963%;截至本报告期末泰康现金资产基金8净值增长率为0.7054%;截至本报告期末泰康现金资产基金9净值增长率为0.7054%;同期业绩比较基准增长率为0.7343%。

4.6 报告期内本基金有人数或基金净值预警说明

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人数不满二百人,或者基金净值低于五千万的情况。

5 投资组合分析

5.1 报告期内本基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,632,013,948.07	57.86
2	其中:银行存款	1,632,013,948.07	57.86
3	资产支持证券	-	-
4	买入返售金融资产	822,373,233.16	29.15
5	权益投资	-	-
6	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-

5.2 投资组合分析

注:证券从属的会议通过并经过协会《证券基金从业人员资格管理办法》的相关规定,定,其中在任职期间及离职后日期均符合相关法律法规关于从业披露的要求。

4.2 报告期内本报告期内本基金遵守守信情况的说明

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

本基金管理人严格按照法律法规和基金合同的约定,建立了公平交易管理制度,并严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司资产管理公平制度,通过系统和技术手段在各个环节严格执行投资公平执行。在投资管理活动中,各投资组合按照投资管理制度和流程独立决策,并在存在利益冲突时,优先满足机构投资者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预警系统,对异常交易行为进行事前、事

和重大事项的披露。报告期内,没有发现本基金管理人存在因投资活动参与的交易所支付交易佣金与交易成交额的比例交易佣金超过约定最高比例的情况。报告期内也未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年报告期内,宏观经济保持平稳发展,实际上下行压力有所加大。投资方面倾向于保持稳健,得益于内地资产的支撑,同时基建投资增速也低位有小幅回升,其他方面需求有所回升,消费继续下降通道,出口则面临外需弱性的影响。物价方面,CPI保持平稳,PPI在低通胀低位较松下行。金融条件方面,社融增速持续下降,利率则在高位有小幅回升。

债券市场方面,四季度利率持续震荡下行。整个季度来看,利率下行的趋势较顺畅,主要也是基本面上下行压力加大,经济和金融数据低于预期,带动风险偏好有所调整,同时货币政策宽松,货币政策目标和传导也是重要助力。利率较年初明显下行,在12月中旬,地产信贷发行的边际放缓,引发了市场对地产放松的预期,但此后在预期被证伪,利率重回下行通道。全季度来看,10Y国债下行38bp,10Y国开下行56bp。

固收投资方面,基金维持了中性的久期策略。此外,基金主要配置信用风险可控的利率债和高等信用债,以及获取相对稳健的持有期收益。同时配置适当运用杠杆为7即可平衡,可交债,以增强组合收益。

4.5 报告期内基金业绩表现情况

截至本报告期末,净值增长率和A基金份额净值为1.1150元,本报告期基金份额净值增长率为1.84%;截至本报告期,净值增长率和C基金份额净值为1.2338元,本报告期基金份额净值增长率为1.77%;同期业绩比较基准增长率为0.53%。

4.6 报告期内基金持有人数量或基金资产净值预警

本报告期内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(%)
1	权益投资		
	其中:股票		
2	基金投资		
3	固定收益投资	238,067,716.10	96.76
	其中:债券	238,067,716.10	96.76
	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:买入返售的银行承兑汇票		
	其他金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	3,147,187.10	1.28
8	其他资产	4,838,201.94	1.97
9	合计	246,053,905.14	100.00

注:以上基金本报告期末未通过开放式交易机构进行港股投资。

量化多策略混合型基金

2019 年第四季度报告

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投资交易系统投资基金管理人公平交易制度指导意见），由公平交易委员会定期通过系统统一等方式在各个环节公平交易制度执行，在投资管理公平交易方面，各投资组合均按照投资管理制度和流程执行，并在取得投资信息、投资决策和执行实施投资决策方面享有平等的机会。

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、事后监控。报告期内，没有发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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年四季度，宏观经济保持平稳发展，上游资产下压力有所加大。投资方面保持相对谨慎，得益于地产产业链的支撑，同时基建投资增速虽处低位但小幅反弹。其他两大部分需求下滑，消费继续下滑通缩，出口则面临欧美贸易的收缩。物价方面，CPI保持平稳，PPI在供给端边际放松下有所下行。金融操作方面，社融增速持续下行，CPI则在通胀预期下有所回升。

权益市场方面，18H4季度市场对经济下行的判断愈发清晰，但Q2以来上证指数类资产取得阶段性反弹，同时国家在政策改革和改革基金上亦进一步明确了减持并鼓励长期资金入市，在此基础上，市场呈现企稳筑底的迹象下行。上证指数11.61%，沪深300下跌3.45%，中小板指下跌12.82%，创业板指下跌12.09%，从行业来看，农林牧渔、电力设备、房地产、通信等板块表现相对较好，石油石化、钢铁、医药、食品饮料等行业表现欠佳。

投资操作方面，本基金采用量化投资的方式，综合考虑股票市场的成因因子、估值因子、质量因子、动量因子等方面的表现，严格遵照选股模型进行投资，分散化投资，力求为基金份额持有人取得较好的回报。

4.5 报告期内基金的投资业绩和业绩比较基准

截至本报告期末泰康策略量化6号基金净值份额为30.9328元，本报告期基金净值份额净增长率为12.27%，截至本报告期末泰康策略量化6号基金净值份额为30.0002元，本报告期基金净值净增长率为-12.49%，同期业绩比较基准增长率为-9.84%。

4.6 报告期内基金持有人或基金资产净值变动

本报告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况。

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(%)
1	权益投资	163,327,569.93	79.00
2	固定收益	163,327,569.93	79.00
3	基金投资	-	-
3.1	固定收益类投资	11,000,400.00	5.36
3.2	其中:债券	11,000,400.00	5.36
4	资产支持证券	-	-
4.1	基金投资	-	-
4.2	基金资产公允价值	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
6.1	其中:买入返售的买入金融	-	-
6.2	其中:买入返售的卖出金融	-	-
7	银行存款及结算备付金合计	13,087,183.36	6.33
8	其他资产	19,260,985.44	9.36
9	合计	206,736,138.73	100.00

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分组的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔、食品	-	-
B	采矿业	3,764,899.05	1.83
C	制造业	100,648,056.65	51.47
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	2,639,728.22	1.26
E	建筑业	9,211,389.00	4.53

金

3	银行存款和结算备付金合计	363,426,500.06	122.63
4	其他资产	13,462,022.74	0.48
5	合计	2,821,266,706.21	100.00

5.2 报告期末债券回购融资情况

项目		占基金资产净值的比例(%)	
序号	报告期内债券回购融资余额	8.80	
项目	其中:政策性金融债融资余额	—	
序号	报告期末债券回购融资余额	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
项目	其中:政策性金融债融资余额	413,969,880.04	17.30

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为本报告期内每个交易日融资金额占资产净值比例的平均值。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。
报告期内基金资产净值未发生负波动,因此本基金资产净值波动率为0%。<

1	国家债券	9,965,438.31	0.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,099,163.65	4.60
其中:政策性金融债	110,099,163.65	4.60	
4	企业债券	-	-
5	企业中期票据	369,352,269.99	6.71
6	中期票据	20,066,621.30	0.84
7	资产支持证券	1,331,341,456.62	56.63
8	其他	-	-
9	合计	1,632,013,948.87	68.20
10	剩余仓位超过30%的浮动补种债券		

5.6 报告期末按资产成本占本基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券面值 (元)	持仓成本(元)	占基金资产 净值比例(%)
1	111898289	18国债农研CD289	1,500,000	148,765,241.70	6.22
2	111898374	18央行票据CD306	1,200,000	110,549,494.23	5.90
3	111897114	18国债农研CD114	1,000,000	99,060,077.66	4.16
4	111815697	18国债农研CD367	1,000,000	99,565,718.13	4.15
5	111898227	18广发银行CD227	1,000,000	99,441,769.72	4.16
6	111898388	18重庆农村商行CD28	1,000,000	99,465,468.81	4.16
7	111898613	18国债农研CD133	1,000,000	99,362,470.13	4.15
8	111898426	18国债农研CD262	1,000,000	99,214,020.13	4.15
9	111893420	18国债农研CD420	1,000,000	99,221,940.61	4.15
10	111898240	18广发银行CD240	1,000,000	99,147,474.06	4.14

基金

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

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种和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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,893,000.00	33.22
	其中:政策性金融债	59,893,000.00	33.22

4	企业债券		45,926,190.00		26.51
5	企业短期融资券		45,227,500.00		26.12
6	中期票据		67,865,700.00		37.70
7	可转债（可交换债）		19,245,326.10		10.69
8	同业存单		-		-
9	其他		-		-
10	合计		238,067,716.10		122.28

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	180406	16收益6	200,200	19,406,000.00	10.78
2	180401	18收益1	100,100	10,464,000.00	5.92
3	10176002	17国债 MTN019	100,100	10,357,000.00	5.75
4	10176040	17广晟投债 MTN001	100,100	10,249,000.00	5.69
5	170210	17财国债10	100,100	10,156,000.00	5.64

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

5.6.1 报告期末未持有资产支持证券。

5.6.2 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

5.6.3 报告期末未持有贵金属。

5.6.4 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

5.6.5 报告期末未持有权证。

5.6.6 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.6.7 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.6.8 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.6.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.6.10 投资衍生品情况说明

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

5.6.12 报告期末本基金未持有股票。

5.6.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,107.62
2	应收证券清算款	306,730.29
3	应收股利	-
4	应收利息	4,462,772.63
5	应收申购款	64,504.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,838,201.01

5.6.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

投资基金

F	批发和零售业	1,566,701.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	1,943,006.40	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,515,369.93	12.03
J	金融业	16,469,980.04	6.43
K	房地产业	5,269,416.60	2.60
L	租赁和商务服务业	1,233,048.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	1,280,444.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	1,933,669.29	0.99
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	1,060,830.00	0.54
S	综合	-	-
	合计	163,327,569.90	83.63

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.3 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组合

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	300394	天孚通信	219,860	5,314,016.20	2.73
2	002115	三维通信	491,460	4,850,118.00	2.42
3	300639	广通	166,360	4,589,608.50	2.29
4	300629	亿联网络	56,500	4,130,130.00	2.25
5	603072	中恒电气	318,360	4,128,024.00	2.12
6	300447	天德信	367,000	3,966,270.00	2.03
7	600039	中信证券	189,084	3,941,643.84	1.98
8	300383	光韵达	231,300	2,930,571.00	1.50
9	300039	歌尔股份	280,680	2,613,346.40	1.34
10	300098	浙新沃	375,125	2,536,848.00	1.30

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,015,400.00	5.63
4	其中:政策性金融债	11,015,400.00	5.63
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	可转债（含交换债）	45,000.00	0.02
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,060,400.00	5.66

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组合

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	180201	18国债01	100,000	10,011,000.00	5.12
2	018005	国开05	10,000	1,054,400.00	0.55
3	110408	海尔转债	420	45,000.00	0.02

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

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

“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离			
项目	偏离情况		
报告期内偏离度的绝对值在0.25%以内(含0.25%)的次数	0		
报告期内偏离度的最高值	0.1090%		
报告期内偏离度的最低值	-0.0181%		
报告期内偏离度绝对值在0.5%以上(不含0.5%)的次数	0		
报告期内偏离度绝对值超过0.5%的情况说明			
在本报告期内本基金与母基金负偏离度的绝对值均未达到0.25%，在本报告期内本基金与母基金正偏离度的绝对值均未达到0.25%。在本报告期内本基金与母基金正偏离度的绝对值均未达到0.5%。			
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十名资产支持证券投资情况			
5.9 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情况			
5.9.1 本基金采用摊余成本法计价。			
5.9.2 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情况			
5.9.3 其他资产构成			
序号	名称	金额(元)	
1	存出保证金		1,434,033
2	应收证券清算款		
3	应收利息		13,844,587.81
4	其他应收款		6,000.00
5	其他流动资产		
6	待摊费用		
7	其他		
8	合计		13,462,022.74
5.9.4 投资报告期内投资的其他文字描述部分			
1. 出于防范五入的影响，本项之与合同之间可能存在尾差。			
2. 报告期内没有说明的投资证券支持投资情况。			
5.6 开放式基金份额变动			
单位:份			
项目	泰康现金管理 货币A	泰康现金管家 货币B	泰康现金管家 货币C
报告期初基金份额总额	62,244,588.60	1,36,653,600.02	1,101,009,183.00
报告期内基金总申购份额	7,767,374.24	802,018,314.93	5,270,183,185.56
报告期内基金总赎回份额	25,556,853.01	590,403,792.79	4,301,386,188.24
报告期末基金份额总额	44,457,110.82	348,268,122.86	1,969,794,181.84
注:(1)报告期内基金申购份额及申购、赎回净收入及其基金份额变动均按四舍五入原则保留小数点后两位,可能导致申购份额合计与资产总额尾差。			
(2)本基金未支付C类份额的销售费。			
5.7 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购买、赎回过投资本基金的交易明细。			
5.8 报告期内前十大资产支持证券持有比例及超过20%的情况			
报告期末前十大资产支持证券持有比例及超过20%的情况			

阶段	序号	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		0.0754%	0.0000%	0.0400%	0.0000%	0.0411%	0.0000
过去一年		0.0754%	0.0000%	0.0400%	0.0000%	0.0411%	0.0000
注:1.本基金收益分配按日结转份额。 2.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期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							

机构	序号	持有基金份额比例①	持有基金份额比例标准差②	持有基金份额比例③	持有基金份额比例标准差④	①-③	②-④
1	20101001-20110100	261,169.1	192,367.04	261,169.1	144.67	0.00	0.00
2	20101010-20110101	100,000.00	521,688.00	100,000.00	301.26	0.00	0.00
个人	1	-	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-	-	-

产品持有有风险							
当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过20%时,基金管理人将审慎确认大额申购和赎回,投资者持有基金份额比例过大导致申购和赎回的风险,申购赎回或赎回支付款项的时间风险,且赎回款项可能无法及时支付,从而给基金份额持有人带来大额赎回时,可能会对基金份额持有人造成一定影响等持有风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

§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现金管家货币市场基金注册的文件;

(二)《泰康现金管家货币市场基金基金合同》;

(三)《泰康现金管家货币市场基金招募说明书》;

(四)《泰康现金管家货币市场基金托管协议》;

9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

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》、《证券时报》、《上海证券报》)或基金管理人互联网网站(<http://www.fundchina.com.cn>)

泰康资产管理有限责任公司

2019年12月2日

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	133009	17年国08B	2,622,120.00	1.57
2	110022	三一转债	2,384,400.00	1.32
3	111013	国开转债	2,262,372.00	1.26
4	126824	17年宝武B	2,225,680.00	1.24
5	132013	17年宝武B	993,200.00	0.65
6	113011	光大转债	946,680.00	0.53
7	123006	东财转债	920,020.00	0.52
8	110040	生医转债	740,560.00	0.41
9	110018	华明转债	411,860.00	0.23
10	131019	普济转债	227,610.00	0.13
11	132011	17年豫01B	184,000.00	0.10
12	110034	九州转债	54,660.00	0.03

5.10.5 报告期内前十名股票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。

5.10.6 投资组合备附注的其他文本披露说明

1、由于五五八的原因,分母之和与合计之间可能存在误差。

2、报告期内无需说明的证券投资决策程序。

§6 开放式基金资产变动

项目	泰康颐康增利债券A	泰康颐康增利债券C
报告期期初基金份额总额	139,010,760.03	21,513,396.00
报告期期末基金份额总额	5,475,428.00	24,006,291.44
报告期基金份额减少总额(份额减少) —(减少—)	2,006,007.17	29,027,273.80
报告期期末基金份额变动额(份额减少) —(减少—)	143,191,352.86	56,091,412.94

注:报告期期间内基金总申购份额含红利再投、转换转入基金份额;基金总赎回份额含转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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投资品种。

§ 8 影响投资者份额比例的其他重要信息

8.1 报告期内—投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金份额情况	
投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间	期初份额	期末份额	持有的份额	持有的份额占比
机构	1	20181001—20181231	99,989,000.00	0.00	0.00	62.62%
个人						

产品持有风险

当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或超过20%时,基金管理人将审慎确认大额申购和赎回,投资者大额申购和赎回可能受到基金申购赎回的影响,申购赎回或赎回支付款项可能会受到基金份额持有人,以及基金管理人确认大额申购与赎回可能对基金份额持有人造成一定不利影响,特此提示。

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颐康增利债券型证券投资基金注册的文件;

(二)《泰康颐康增利债券型证券投资基金合同》;

(三)《泰康颐康增利债券型证券投资基金招募说明书》;

(四)《泰康颐康增利债券型证券投资基金托管协议》。

9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

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》、《证券时报》、《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网站(<http://www.tkfunds.com.cn>)。

泰康资产管理有限责任公司
2019年11月22日

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。

本基金报告期内未投资股指期货。

5.10 本报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期末本基金投资组合的前十名证券发行主体未被监管部门立案调查的,在报告编制前一年内未收到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金投资组合的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

6.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	110,854.32
2	应收证券清算款	17,734,452.51
3	应收股利	-
4	应收利息	413,491.91
5	应收申购款	2,196.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,260,985.44

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限原因	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	3,041,643.94	1.56	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、由于四五1号的原因,自项之与自台项之间可能存在误差。

2、报告期内没有说明的证券投资决策程序。

6 开放式基金资产变动

项目	泰康睿利量化多策略组合A	泰康睿利量化多策略组合C
报告期期初基金份额总额	291,766,989.91	43,562.34
报告期期间基金总申购份额	2,389,033.97	53,117.70
减:报告期期间基金总赎回份额	12,006,914.00	-
报告期期间基金总申购份额减少:“赎回”	-	-
报告期期末基金份额总额	282,152,309.78	96,670.04

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转出份额。

7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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%的基本情况

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睿利量化多策略组合型证券投资基金注册的文件;
- (二)《泰康睿利量化多策略组合型证券投资基金基金合同》;
- (三)《泰康睿利量化多策略组合型证券投资基金招募说明书》;
- (四)《泰康睿利量化多策略组合型证券投资基金托管协议》;

9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露网站(《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网站(<http://www.tkfunds.com>)、上海

泰康资产管理有限责任公司