

泰康丰盈债券型证券投资基金

2016年度报告摘要

基金管理人:泰康资产管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30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连带责任。年度报告书经基金经理人签署后,并由基金经理人签字。

基金托管人中国工商银行股份有限公司以下简称“中国工商银行”根据本基金基金合同规定,于2016年3月24日核对了本基金的财务指标、净值表现和投资组合报告,确认不存在虚假记载、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财产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来的业绩,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定期报告。

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2016年3月24日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金的基本情况

基金名称 泰康丰盈债券
基金代码 0002009
基金运作方式 灵活配置型开放式
基金合同生效日 2016年3月24日
基金管理人 泰康资产管理有限责任公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额 779,887,032.23
基金份额总额 不适用

2.2 基金产品说明

投资目标 在遵守法律法规及基金合同的前提下,在合理控制风险的基础上,追求资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金综合运用定量分析和定性分析方法,全面评估证券市场的投资环境,并广泛地运用量化投资策略,以期在不同类型的资产类别中获取收益。本基金将通过深入研究宏观经济、政策环境、行业趋势、公司基本面、估值水平、资金流动性和市场情绪等,在严格控制风险的前提下,精选具有持续竞争优势的公司,通过积极主动的资产配置,在不同资产类别之间进行动态调整,以期在不同市场环境下实现基金资产的稳定增值。

业绩比较基准 10%×沪深300指数收益+90%×中债新综合财富(总值)指数

风险收益特征 本基金为债券型基金,属于债券型基金中风险收益适中的品种,其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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人
名称 泰康资产管理有限责任公司 中国工商银行股份有限公司
姓名 谭海 谭海
信息披露负责人 联系电话 010-60105772 010-60105799
电子邮箱 zhanglei@taikeji.com.cn zhanglei@icbc.com.cn
客户服务电话 4001096622 95588
传真 010-60105798

2.4 信息披露方式

登载在中国证监会指定的报刊和互联网网站
www.taikeji.com.cn

基金份额净值公告的披露日

§ 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 利润数据和指标 2016年8月24日基金合同生效日至2016年12月31日

本期利润 6,002,220.04

收入/均摊的本期利润 6,002,220.04

本期利润/均摊的本期利润 1.00

3.1.2 利润数据和指标 2016年末

利润/未分配利润 0.0076

期末未分配利润/利润 0.0076

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的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.2 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.3 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.4 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.5 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.6 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.7 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.8 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.9 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.10 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.11 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.12 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.13 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.14 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.15 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.16 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.17 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.18 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.19 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.20 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.21 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.22 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.23 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.24 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.25 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.26 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.27 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.28 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.10% 0.14% 0.30% -0.04%

3.2.29 基金份额收益以来基金额度累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份额增长 累计份额增长 累计份额增长 累计份额增长
基期至三月 -1.02% 0.11% -1.00% 0.16% 0.00% -0.06%
期后至今 -0.07% 0.1