

泰康安益纯债债券型证券投资基金

2017第一季度报告

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：2017年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人报告了本公司根据基金合同规定，于2017年4月10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信息，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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	泰康安益纯债债券
交易代码	000258
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月30日
报告期末基金份额总额	406,600,334.28
投资目标	在合理控制风险并保持资产流动性的基础上，力求超越业绩比较基准的回报，力争实现基金的长期稳健增值。
投资策略	本基金在综合运用定性分析和定量分析方法，全面评估证券市场的投资环境，结合对宏观经济、政策、利率、货币市场、行业、上市公司基本面、估值水平、资金面等多方面的深入研究，在此基础上，制定本基金各类资产的战略配置比例，并定期进行动态调整。在坚持“风险收益一致”的原则下，通过严格的风险预算，结合对市场资金的需求变化及变化趋势，动态调整组合久期，适时调整债券的期限结构，从而达到在控制风险的前提下获取较高的收益。本基金将通过深入的行业研究，结合对企业的基本面分析，选择具有较好发展前景的公司股票进行投资，以达到在相对吸引能力、研究应用能力较强的条件下获取超额收益。
业績比較標準	本基金选择业绩基准为中证综合债指数（收益率*6%+金融机构人民币存款利率*1%）作为业绩比较基准。
風險收益特征	本基金为债券基金，属于较低风险品种，同时风险与预期回报率高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
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
下屬分級基金的基金簡介	泰康安益純債債券A 泰康安益純債債券C
下屬分級基金的交易代码	000258 000259
報告期末下屬分級基金的份額總額	406,466,137.76份 139,106.96份

§ 3 主要財務指標和基金淨值表現

单位：人民币元

主要財務指標

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

泰康安益纯债债券 A 泰康安益纯债债券C

1.本期已实现收入 2,239,700.57 63.19

2.本期利润 3,321,624.30 1,024.42

3.加权平均基金份额本期利润 0.0082 0.0084

4.期末基金份额净值 407,062.02/38.16 158,103.50

5.期末基金份额总额 1,0015 1,1368

注：(1)本期利润为收入减去必要的费用后的余额，本期利润为0.0082元/份。

(2)上述基金额度的计算不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值增长率为每份额净值的增长率，即(本期利润+期末未分配利润)/期末基金份额净值。

3.3 基金的净值表现

3.2.1 本期基金份额净值增长率为每份额净值的增长率，即(本期利润+期末未分配利润)/期末基金份额净值。

3.2.2 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.4 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.5 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.6 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.7 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.8 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.9 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.10 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.11 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.12 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.13 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.14 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.15 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.16 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.17 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.18 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.19 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.20 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.21 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.22 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.23 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.24 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.25 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.26 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.27 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.28 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.29 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.30 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.31 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.32 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.33 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.34 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.35 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.36 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.37 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.38 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.39 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.40 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.41 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.42 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.43 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.44 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.45 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.46 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.47 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.48 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.49 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.50 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.51 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.52 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.53 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.54 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.55 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.56 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.57 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.58 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.59 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.60 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.61 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.62 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.63 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.64 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.65 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.66 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.67 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.68 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.69 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.70 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.71 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.72 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.73 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.74 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.75 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.76 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.77 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.78 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.79 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.80 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.81 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.82 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.83 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.84 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.85 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.86 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.87 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.88 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.89 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.90 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.91 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.92 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.93 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.94 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.95 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.96 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.97 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.98 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.99 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.100 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.101 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.102 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.103 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.104 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.105 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.106 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.1