

泰康安惠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:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2017年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4月19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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期为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		泰康安惠债券	
交易代码	000370	基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月26日	报告期末基金资产净值	240,090,624.01份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，力求超越业绩比较基准的投资回报，力争在同类基金中取得长期稳定的绝对收益。		
投资策略	本基金将通过积极的债券投资，包括但不限于信用债之间的相对投资组合管理，从而择机调整组合久期和期限结构，把握市场变化及信用利差变化带来的投资机会，重点分析利率债与信用债的利差变化，利用信用债的票息收入，同时密切关注信用债的信用风险，识别信用债的信用风险，从而获得信用利差带来的投资收益。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：中债综合财富(总值)指数收益率*96%+银行存款利率(税后)*4%		
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金，属于债券型基金中的中等风险品种。		
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
1本期实现收益		1,024,210.09	
2本期利润		2,056,229.13	
3加权平均基金份额本期利润		0.0008	
4期末基金份额净值		242,562,699.21	
5期末可供分配基金份额总额		10,102	

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。

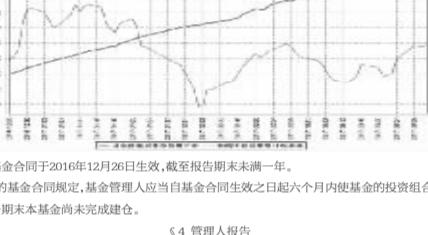
(2)本基金的基本面指标不包括持有人认购交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.09%	0.02%	-0.31%	0.00%	12.7%	-0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金合同于2016年12月26日生效，截至报告期末未满一年。

2.按本基金的基本面指标不包括持有人认购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 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	任职本基金基金经理的日期
任翀	2016年12月26日
本基金基金经理	-
说明	任翀于2016年7月加入泰康资产管理有限责任公司，担任固定收益部研究员，期间负责信用债研究工作，期间曾担任过信用债研究员、信用债分析师、信用债高级研究员等职务。2016年3月23日起担任本基金基金经理，2016年8月10日起担任泰康安泰纯债债券型证券投资基金基金经理，2016年12月26日起担任本基金基金经理。

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 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

报告期内，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

本基金基金管理人公平对待旗下所有的基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资组合情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 公平交易执行的情况

本基金基金管理人建立健全了异常交易监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.6 报告期内基金投资组合的行业配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.7 报告期内基金投资组合的风格配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.8 报告期内基金投资组合的区域配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.9 报告期内基金投资组合的券种配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.10 报告期内基金投资组合的行业配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.11 报告期内基金投资组合的风格配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.12 报告期内基金投资组合的区域配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.13 报告期内基金投资组合的券种配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.14 报告期内基金投资组合的行业配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.15 报告期内基金投资组合的风格配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.16 报告期内基金投资组合的区域配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.17 报告期内基金投资组合的券种配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.18 报告期内基金投资组合的行业配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.19 报告期内基金投资组合的风格配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.20 报告期内基金投资组合的区域配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.21 报告期内基金投资组合的券种配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.22 报告期内基金投资组合的行业配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.23 报告期内基金投资组合的风格配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.24 报告期内基金投资组合的区域配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.25 报告期内基金投资组合的券种配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.26 报告期内基金投资组合的行业配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.27 报告期内基金投资组合的风格配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.28 报告期内基金投资组合的区域配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度和流程，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量虽然该证券当日成交量5%的情况。报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.29 报告期内基金投资组合的券种配置情况

本基金基金管理人严格按照公司公平交易制度