

# 泰康安益纯债债券型证券投资基金

## 2017 年年度报告摘要

2017 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 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。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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |              |
|-----------------|------------------|--------------|
| 基金简称            | 泰康安益纯债债券         |              |
| 基金主代码           | 002528           |              |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |              |
| 基金合同生效日         | 2016 年 8 月 30 日  |              |
| 基金管理人           | 泰康资产管理有限责任公司     |              |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司     |              |
| 报告期末基金份额总额      | 365,804,757.87 份 |              |
| 基金合同存续期         | 不定期              |              |
| 下属分级基金的基金简称:    | 泰康安益纯债债券 A       | 泰康安益纯债债券 C   |
| 下属分级基金的交易代码:    | 002528           | 002529       |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 365,699,845.47 份 | 104,912.40 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略   | 本基金综合运用定量分析与定性分析手段,全面评估证券市场当期的投资环境,并对可以预见的未来时期内各类别资产的风险收益状况进行分析与预测。在此基础上,制定本基金各类资产的战略配置比例,并定期或不定期进行调整。本基金通过分析宏观经济运行情况、判断经济政策取向,对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断,结合债券市场资金供求结构及变化趋势,动态调整组合久期及期限结构配置。另外,本基金通过研究市场整体信用风险趋势,结合企业机构类债券的供需情况以及替代资产相对吸引力,研判信用利差趋势,并结合利率风险,以确定组合的企业机构类债券的投资比例。 |
| 业绩比较基准 | 中债新综合财富(总值)指数收益率*95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%                                                                                                                                                                                                                                        |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属于较低风险品种,预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。                                                                                                                                                                                                                              |

### 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               | 中国民生银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 陈玮光                        | 罗菲菲                   |
|         | 联系电话 | 010-58753683               | 010-58560666          |
|         | 电子邮箱 | chenwg06@taikangamc.com.cn | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 4001895522                 | 95568                 |
| 传真      |      | 010-57818785               | 010-58560798          |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                    |
|---------------------|--------------------|
| 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  |

## § 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 | 2017 年         |            | 2016 年 8 月 30 日 (基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 |            |
|---------------|----------------|------------|--------------------------------------------|------------|
|               | 泰康安益纯债债券 A     | 泰康安益纯债债券 C | 泰康安益纯债债券 A                                 | 泰康安益纯债债券 C |
| 本期已实现收益       | 8,193,013.96   | 2,149.34   | -2,860,270.31                              | 87,257.32  |
| 本期利润          | 7,109,682.67   | 1,835.39   | -3,660,635.10                              | 236,771.93 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0188         | 0.0160     | -0.0091                                    | 0.0180     |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.94%          | 1.64%      | -0.70%                                     | 12.70%     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末        |            | 2016 年末                                    |            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0123         | 0.1455     | -0.0067                                    | 0.1274     |
| 期末基金资产净值      | 370,188,317.90 | 120,180.37 | 403,972,765.17                             | 72,160.13  |
| 期末基金份额净值      | 1.0123         | 1.1455     | 0.993                                      | 1.127      |

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。

## 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

泰康安益纯债债券 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      | -0.33%   | 0.05%       | -0.40%     | 0.05%         | 0.07% | 0.00%  |
| 过去六个月      | 0.66%    | 0.04%       | 0.35%      | 0.04%         | 0.31% | 0.00%  |
| 过去一年       | 1.94%    | 0.05%       | 0.26%      | 0.06%         | 1.68% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.23%    | 0.08%       | -0.82%     | 0.08%         | 2.05% | 0.00%  |

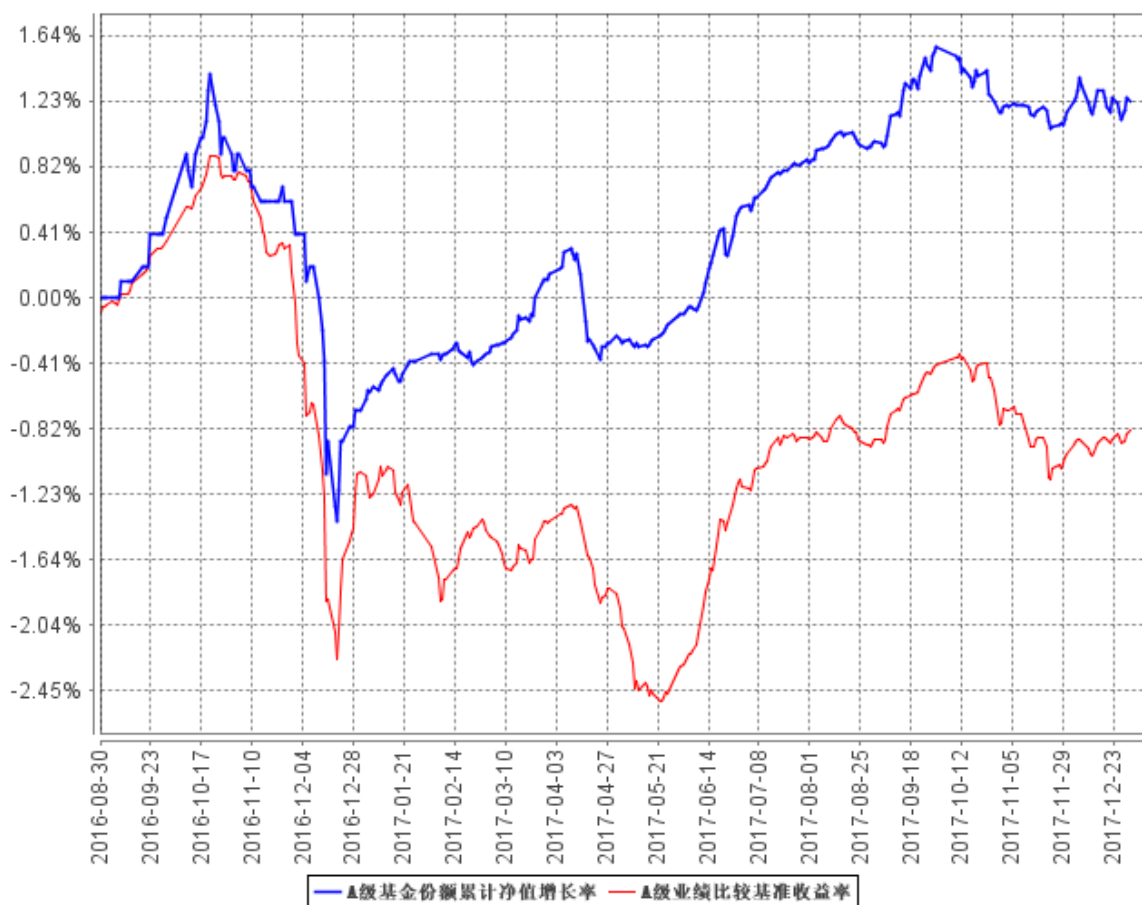
泰康安益纯债债券 C

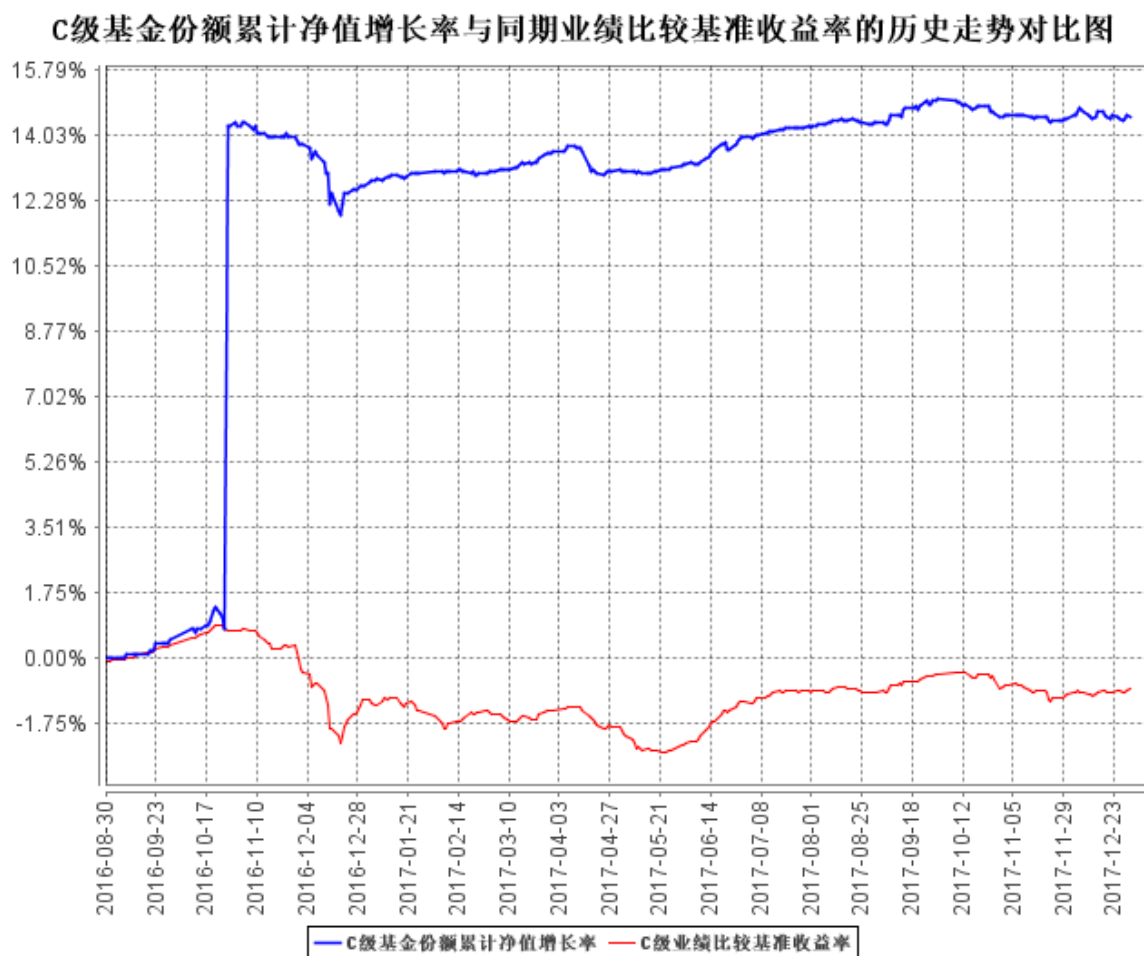
| 阶段 | 份额净值增 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|----|-------|------|------|--------|-----|-----|
|----|-------|------|------|--------|-----|-----|

|                | 长率①    | 增长率标准<br>差② | 基准收益<br>率③ | 收益率标准<br>差④ |        |        |
|----------------|--------|-------------|------------|-------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -0.41% | 0.05%       | -0.40%     | 0.05%       | -0.01% | 0.00%  |
| 过去六个月          | 0.50%  | 0.04%       | 0.35%      | 0.04%       | 0.15%  | 0.00%  |
| 过去一年           | 1.64%  | 0.05%       | 0.26%      | 0.06%       | 1.38%  | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 14.55% | 0.74%       | -0.82%     | 0.08%       | 15.37% | 0.66%  |

### 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**



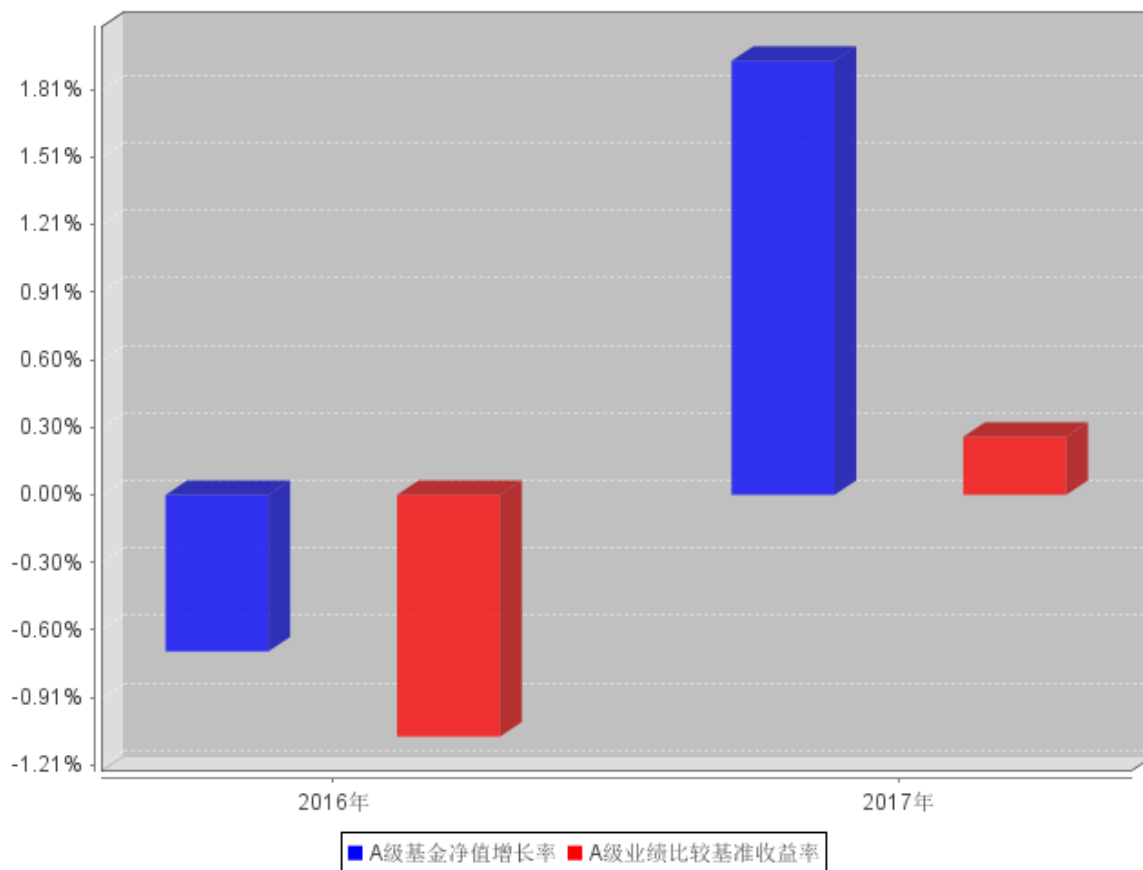


注：1、本基金基金合同于 2016 年 8 月 30 日生效。

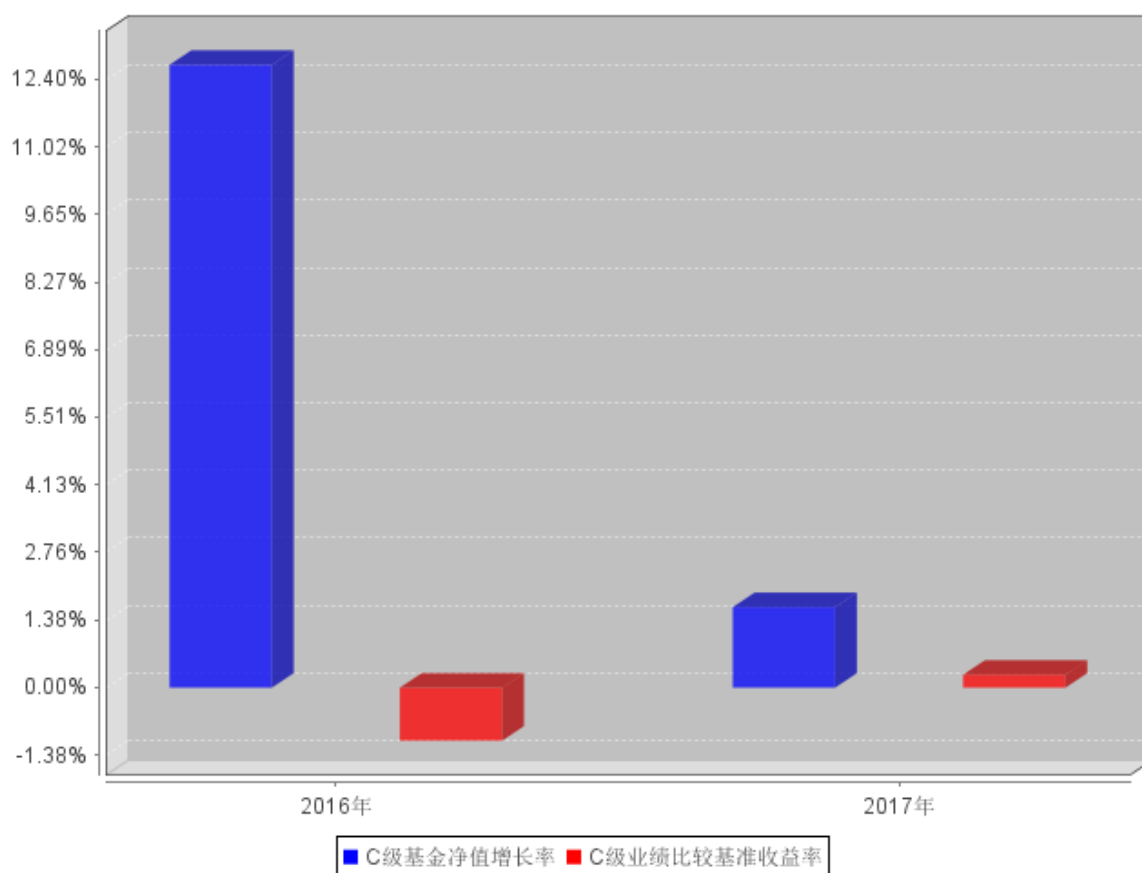
2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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**



**C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2016年8月30日，2016年度净值增长率的计算期间为2016年8月30日至2016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（2016年8月30日）至报告截止日（2017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 2 月,前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心。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、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 2017 年 12 月 31 日,公司管理着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和泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金共二十一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 |        |                                                                                           |
| 任翀 | 本基金基金经理 | 2016 年 8 月 30 日 | —    | 9      | 任翀于 2015 年 7 月加入泰康资产,现担任公募事业部固定收益投资经理。曾任职于安信基金管理有限公司固定收益投资部、中国银行总行金融市场总部。2016 年 3 月 23 日起 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>至今担任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2016 年 8 月 30 日起至今担任泰康安益纯债债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>2016 年 12 月 26 日起至今担任泰康安惠纯债债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>2017 年 11 月 1 日起至今担任泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。</p> <p>2017 年 12 月 27 日起至今担任泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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合规守信情况的说明

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

2017 年全年，宏观经济韧性较强，四季度的 GDP 增速分别是 6.9、6.9、6.8、6.8，上半年经济增速有所回升，下半年企稳。从三大需求来看，投资增速前高后低，但主要原因是基建投资增速的下滑，房地产投资的韧性较强，而制造业投资在四季度则有所回升；零售增速保持平稳，出口得益于全球经济复苏而显著改善。CPI 较为温和，PPI 小幅回落，但仍然保持高位。央行的货币政策总体稳健中性，公开市场利率全年跟随美联储加息三次，流动性保持在紧平衡的态势。汇率方面，受经济韧性强、美元指数贬值的影响，人民币呈现震荡升值的态势。

债券市场方面，利率震荡上行，全年调整的幅度较大。具体来看，年初由于跟随美联储调整公开市场利率，银监会“三三四”检查、金融监管趋严，利率有所上行；年中受到环保督察的影响，基本面小幅低于预期，同时监管强调协调推进，利率步入到震荡的行情；进入到四季度，十九大政通人和，修正了市场对经济的预期，同时通胀预期再起，资管新规等监管政策密集出台，多重利空叠加，导致利率快速上行。全年来看，10Y 国债上行了 87bp，10Y 国开上行了 114bp。

报告期内，基金整体维持高等级中低久期策略。当市场出现阶段性机会的时候，适度提高久期把握市场的反弹。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康安益纯债债券 A 基金份额净值为 1.0123 元，本报告期基金份额净值增长

率为 1.94%；截至本报告期末泰康安益纯债债券 C 基金份额净值为 1.1455 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.64%；同期业绩比较基准收益率为 0.26%。

#### 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 2018 年，我们认为全球经济仍将延续 2017 年的同步复苏格局，国内宏观经济短期可能会受采暖季限产、非标收紧、基建投资增速趋缓等原因略有下行，但一些中长期的结构性问题正在逐步解决，因此经济内生的动能正在增强。通胀方面，我们认为去年低基数导致的通胀预期正在增强，且 4 季度前可能无法证伪。金融监管方面，金融去杠杆仍将是债市贯穿全年的主题。以上三因素是债市面临的最大利空。利好则在于目前利率已经处于历史相对高位，配置价值开始显现。我们认为目前短久期仍然是最优策略，趋势性的机会还需要耐心等待。

#### 4.6 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，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。公司估值小组设成员若干名，成员由各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理中心公募运营部、公募投资部、监察稽核部、公募产品部等。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，本基金管理人根据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》对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依据流动性折扣确定股票价值。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。

#### 4.7 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，本基金未进行利润分配。

#### 4.8 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合规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金 2017 年年度报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：泰康安益纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                                 |                                  |
| 银行存款            | 236,077.37                      | 4,319,424.57                     |
| 结算备付金           | 2,970,861.73                    | 1,220,321.78                     |
| 存出保证金           | 204.30                          | 986,704.12                       |
| 交易性金融资产         | 494,323,950.00                  | 353,263,443.50                   |
| 其中：股票投资         | -                               | -                                |
| 基金投资            | -                               | -                                |
| 债券投资            | 494,323,950.00                  | 353,263,443.50                   |
| 资产支持证券投资        | -                               | -                                |
| 贵金属投资           | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | -                               | 99,890,469.84                    |
| 应收证券清算款         | -                               | -                                |
| 应收利息            | 10,340,254.36                   | 4,793,096.21                     |
| 应收股利            | -                               | -                                |
| 应收申购款           | 4,197.60                        | 994.04                           |
| 递延所得税资产         | -                               | -                                |
| 其他资产            | -                               | -                                |
| 资产总计            | 507,875,545.36                  | 464,474,454.06                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |                                 |                                  |
| 短期借款            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       | 137,013,603.50                  | 59,999,710.00                    |
| 应付证券清算款         | -                               | -                                |
| 应付赎回款           | 2,092.40                        | -                                |
| 应付管理人报酬         | 188,791.68                      | 212,568.83                       |
| 应付托管费           | 47,197.90                       | 53,142.24                        |
| 应付销售服务费         | 30.60                           | 66.59                            |
| 应付交易费用          | 17,963.97                       | 26,939.94                        |
| 应交税费            | -                               | -                                |
| 应付利息            | 168,365.92                      | 10,501.16                        |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 应付利润          | -              | -              |
| 递延所得税负债       | -              | -              |
| 其他负债          | 129,001.12     | 126,600.00     |
| 负债合计          | 137,567,047.09 | 60,429,528.76  |
| <b>所有者权益：</b> |                |                |
| 实收基金          | 365,804,757.87 | 406,762,304.04 |
| 未分配利润         | 4,503,740.40   | -2,717,378.74  |
| 所有者权益合计       | 370,308,498.27 | 404,044,925.30 |
| 负债和所有者权益总计    | 507,875,545.36 | 464,474,454.06 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0123 元，C 类基金份额净值 1.1455 元。

基金份额总额 365,804,757.87 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 365,699,845.47 份；C 类基金份额总额 104,912.40 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰康安益纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           | 11,777,426.67                          | -2,129,033.15                                         |
| 1.利息收入                | 17,539,409.76                          | 4,385,784.09                                          |
| 其中：存款利息收入             | 55,248.26                              | 163,591.51                                            |
| 债券利息收入                | 16,676,349.40                          | 3,353,982.89                                          |
| 资产支持证券利息收入            | -                                      | -                                                     |
| 买入返售金融资产收入            | 807,812.10                             | 868,209.69                                            |
| 其他利息收入                | -                                      | -                                                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | -4,688,727.94                          | -5,877,428.98                                         |
| 其中：股票投资收益             | -                                      | -                                                     |
| 基金投资收益                | -                                      | -                                                     |
| 债券投资收益                | -4,104,677.94                          | -5,900,428.98                                         |
| 资产支持证券投资收益            | -                                      | -                                                     |
| 贵金属投资收益               | -                                      | -                                                     |
| 衍生工具收益                | -584,050.00                            | 23,000.00                                             |
| 股利收益                  | -                                      | -                                                     |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -1,083,645.24                          | -650,850.18                                           |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                      | -                                                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 10,390.09                              | 13,461.92                                             |
| <b>减：二、费用</b>         | 4,665,908.61                           | 1,294,830.02                                          |

|                     |              |               |
|---------------------|--------------|---------------|
| 1. 管理人报酬            | 2,279,995.94 | 839,050.08    |
| 2. 托管费              | 569,999.07   | 209,762.53    |
| 3. 销售服务费            | 392.19       | 14,506.57     |
| 4. 交易费用             | 37,179.04    | 18,102.18     |
| 5. 利息支出             | 1,441,207.91 | 49,699.90     |
| 其中：卖出回购金融资产支出       | 1,441,207.91 | 49,699.90     |
| 6. 其他费用             | 337,134.46   | 163,708.76    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 7,111,518.06 | -3,423,863.17 |
| 减：所得税费用             | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | 7,111,518.06 | -3,423,863.17 |

注：本基金合同生效日为 2016 年 8 月 30 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2016 年 8 月 30 日至 2016 年 12 月 31 日止期间。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康安益纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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）                        | 406,762,304.04                                        | -2,717,378.74 | 404,044,925.30 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                     | 7,111,518.06  | 7,111,518.06   |
| 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）      | -40,957,546.17                                        | 109,601.08    | -40,847,945.09 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 811,639.95                                            | 36,288.26     | 847,928.21     |
| 2. 基金赎回款                               | -41,769,186.12                                        | 73,312.82     | -41,695,873.30 |
| 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）                        | 365,804,757.87                                        | 4,503,740.40  | 370,308,498.27 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2016 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2016 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）                        | 406,659,212.54 | -             | 406,659,212.54 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -              | -3,423,863.17 | -3,423,863.17  |
| 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）      | 103,091.50     | 706,484.43    | 809,575.93     |
| 其中：1. 基金申购款                            | 82,023,733.76  | 442,297.33    | 82,466,031.09  |
| 2. 基金赎回款                               | -81,920,642.26 | 264,187.10    | -81,656,455.16 |
| 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）                        | 406,762,304.04 | -2,717,378.74 | 404,044,925.30 |

注：本基金合同生效日为 2016 年 8 月 30 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2016 年 8 月 30 日至 2016 年 12 月 31 日止期间。

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：

|              |             |              |
|--------------|-------------|--------------|
| _____<br>段国圣 | _____<br>魏宇 | _____<br>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

泰康安益纯债债券型证券投资基金(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[2016]第 358 号《关于准予泰康安益纯债债券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《泰康安益纯债债券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 406,651,308.54 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(2016)第 1093 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康安益纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 406,659,212.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 7,904.00 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“民生银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康安益纯债债券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债券资产（包括但不限于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、分离交易可转债的纯债部分、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（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、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。基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中债新综合财富（总值）指数收益率 $\times$ 95% + 金融机构人民币活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

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 2018 年 3 月 29 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》、《泰康安益纯债债券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 2017 年度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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致，会计估计较最近一期年度报告有变更。

#### 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

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”),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,本基金自2017年12月28日起改为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。

#### 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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[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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

(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。

#### 7.4.7 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           |
| 中国民生银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构        |
| 泰康资产管理有限责任公司 | 基金管理人、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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间 2016 年 8 月 30 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 8 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,279,995.94                           | 839,050.08                                              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,279.96                               | 1,738.55                                                |

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 0.60% 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 × 0.60% / 当年天数。

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 8 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 569,999.07                             | 209,762.53                                              |

注：支付基金托管人 民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

### 7.4.8.2.3 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>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日                |            |           |
|----------------|-------------------------------------------------------|------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                      |            |           |
|                | 泰康安益纯债债券 A                                            | 泰康安益纯债债券 C | 合计        |
| 民生银行           | -                                                     | 0.10       | 0.10      |
| 泰康资产管理有限责任公司   | -                                                     | 79.21      | 79.21     |
| 合计             | -                                                     | 79.31      | 79.31     |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |            |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                      |            |           |
|                | 泰康安益纯债债券 A                                            | 泰康安益纯债债券 C | 合计        |
| 民生银行           | -                                                     | -          | -         |
| 泰康资产管理有限责任公司   | -                                                     | 14,326.86  | 14,326.86 |
| 合计             | -                                                     | 14,326.86  | 14,326.86 |

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 0.30%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 0.30%/ 当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日                |               |      |       |      |       |      |
|-------------------------------------------------------|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                                        | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                                       | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 民生银行                                                  | 28,968,218.22 | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2016 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |               |      |       |      |       |      |
| 银行间                                                   | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |

| 市场交易的各关联方名称 | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
|-------------|------|------|------|------|------|------|
| 民生银行        |      | -    | -    | -    | -    | -    |

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间 2016 年 8 月 30 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

份额单位：份

| 泰康安益纯债债券 A   |                         |                  |                          |                  |
|--------------|-------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
| 关联方名称        | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 |                  | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |                  |
|              | 持有的基金份额                 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额                  | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 泰康保险集团股份有限公司 | -                       | -                | 199,999,000.00           | 49.1763%         |

注：1. 泰康人寿保险股份有限公司于 2016 年 8 月 18 日获得保监许可(2016) 816 号批复，更名为泰康保险集团股份有限公司；于 2017 年 4 月 17 日投资账户份额过户给泰康人寿保险有限责任公司；

2. 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。

#### 7.4.8.5 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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2016 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至<br>2016 年 12 月 31 日 |           |
|-------|----------------------------------------|-----------|----------------------------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                                   | 当期利息收入    | 期末余额                                                     | 当期利息收入    |
| 民生银行  | 236,077.37                             | 17,927.19 | 4,319,424.57                                             | 39,865.94 |

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间 2016 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本报告期及上年度可比期间 2016 年 8 月 30 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 130,999,603.5 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|--------|----------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 170210 | 17 国开 10 | 2018 年 1 月 2 日 | 93.34  | 610,000   | 56,937,400.00  |
| 170215 | 17 国开 15 | 2018 年 1 月 2 日 | 95.55  | 700,000   | 66,885,000.00  |
| 合计     |          |                |        | 1,310,000 | 123,822,400.00 |

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 6,014,000.00 元，于 2018 年 1 月 2 日（先后）到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

**7.4.10 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 2017 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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 494,323,950.00 元，无属于第三层次的余额。(2016 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 353,263,443.50 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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 2017 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。(2016 年 12 月 31 日：同)。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 10 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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              | —              | —             |
|    | 其中：股票             | —              | —             |
| 2  | 固定收益投资            | 494,323,950.00 | 97.33         |
|    | 其中：债券             | 494,323,950.00 | 97.33         |
|    | 资产支持证券            | —              | —             |
| 3  | 贵金属投资             | —              | —             |
| 4  | 金融衍生品投资           | —              | —             |
| 5  | 买入返售金融资产          | —              | —             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 3,206,939.10   | 0.63          |
| 7  | 其他各项资产            | 10,344,656.26  | 2.04          |
| 8  | 合计                | 507,875,545.36 | 100.00        |

注：本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

### 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

本基金本报告期内未持有境内股票。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

### 8.3 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

本基金本报告期内未持有股票。

### 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末投资股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末投资股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末投资股票。

### 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      | 160,763,000.00 | 43.41        |
|    | 其中：政策性金融债 | 160,763,000.00 | 43.41        |
| 4  | 企业债券      | 62,612,450.00  | 16.91        |
| 5  | 企业短期融资券   | 225,348,000.00 | 60.85        |
| 6  | 中期票据      | 45,600,500.00  | 12.31        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 494,323,950.00 | 133.49       |

### 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  | 170215    | 17 国开 15     | 700,000 | 66,885,000.00 | 18.06        |
| 2  | 170210    | 17 国开 10     | 700,000 | 65,338,000.00 | 17.64        |
| 3  | 011758055 | 17 潞安 SCP005 | 300,000 | 30,189,000.00 | 8.15         |
| 4  | 041761009 | 17 河钢集 CP003 | 300,000 | 30,093,000.00 | 8.13         |
| 5  | 041764002 | 17 阳煤 CP002  | 200,000 | 20,126,000.00 | 5.43         |

### 8.7 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

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。

**8.11 投资组合报告附注**

**8.11.1** 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。

**8.11.2** 本基金本报告期末未投资于股票。

**8.11.3 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   | 204.30        |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 10,340,254.36 |
| 5  | 应收申购款   | 4,197.60      |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 10,344,656.26 |

**8.11.4 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。

**8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.11.6 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  |
| 泰康安益纯债债券 A | 168      | 2,176,784.79 | 364,645,351.40 | 99.71% | 1,054,494.07 | 0.29%   |
| 泰康安益纯债债券 C | 34       | 3,085.66     | 0.00           | 0.00%  | 104,912.40   | 100.00% |
| 合计         | 202      | 1,810,914.64 | 364,645,351.40 | 99.68% | 1,159,406.47 | 0.32%   |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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 | 泰康安益纯债债券 A | 2,191.76  | 0.0006%  |
|                  | 泰康安益纯债债券 C | 437.45    | 0.4170%  |
|                  | 合计         | 2,629.21  | 0.0007%  |

### 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 | 泰康安益纯债债券 A | 0                 |
|                                | 泰康安益纯债债券 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 泰康安益纯债债券 A | 0                 |
|                                | 泰康安益纯债债券 C | 0                 |

|  |    |   |
|--|----|---|
|  | 合计 | 0 |
|--|----|---|

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 泰康安益纯债债券 A     | 泰康安益纯债债券 C    |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2016 年 8 月 30 日）基金份额总额 | 376,657,772.54 | 30,001,440.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 406,698,298.79 | 64,005.25     |
| 本报告期基金总申购份额                    | 569,518.62     | 242,121.33    |
| 减:本报告期基金总赎回份额                  | 41,567,971.94  | 201,214.18    |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 365,699,845.47 | 104,912.40    |

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于 2017 年 12 月 27 日发布公告，自 2017 年 12 月 25 日起新任陈玮光先生为公募合规负责人，周峰女士不再担任公募合规负责人。

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 40,000.00 元；截至 2017 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 2 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

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 |    |
| 中国国际金融有限公司 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券股份有限公司 | 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、本报告期内本基金租用券商交易单元变更情况：无。

## 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 |
| 中国国际金融有限公司 | —             | —            | —                | —              | —    | —            |
| 中信证券股份有限公司 | 20,082,566.27 | 100.00%      | 1,354,914,000.00 | 100.00%        | —    | —            |

## § 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

| 投资者类别                                                                                                                                     | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                |      |      | 报告期末持有基金情况     |        |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|----------------|------|------|----------------|--------|
|                                                                                                                                           | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额           | 份额占比   |
| 机构                                                                                                                                        | 1              | 20170101-20171231       | 199,999,000.00 | -    | -    | 199,999,000.00 | 54.67% |
|                                                                                                                                           | 2              | 20170419-20171231       | 74,465,325.67  | -    | -    | 74,465,325.67  | 20.36% |
| 个人                                                                                                                                        | -              | -                       | -              | -    | -    | -              | -      |
| 产品特有风险                                                                                                                                    |                |                         |                |      |      |                |        |
| 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与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。 |                |                         |                |      |      |                |        |

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

|   |
|---|
| 无 |
|---|

泰康资产管理有限责任公司

2018 年 3 月 29 日