泰康均衡优选混合型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-06-30

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019-07-19

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标、基金净值表现
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 报告期内基金投资组合情况
§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十名证券投资明细
§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贵金属投资明细
§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权证投资明细
§10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
§11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
§12 投资组合报告附注
§13 开放式基金份额变动
§14 重大事件揭示
§15 影响投资者决策的其他重要信息
§16 备查文件目录

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于本报告期内对本基金的投资运作进行了监督，特别提醒投资者注意，基金管理人对本报告期内基金投资运作的监督职责仍然主要对基金管理人的投资运作合规性、投资决策程序的有效性进行监督，而对投资风险、投资收益等事项不作评价。

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，但不保证本报告期内一定盈利。

基金管理人过去一段时期的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对证券投资基金的风险收益特征进行全面了解。

本报告期内基金的投资组合情况请投资者阅读本报告正文中的相关内容。

本报告期内基金业绩表现请投资者阅读本报告正文中的相关内容。

§2 基金简介

基金基本情况

项目	简称
基金名称	泰康均衡优选混合
基金简称	泰康均衡优选混合
基金主代码	004215
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018-08-10
报告期末基金份额总额	157,392,281.32份
投资目标	在基本满足"可子孙"理念基本收益目标的前提，追求绝对收益以获取长期稳定回报。本基金力争通过对权益类资产严格控制风险，力争基金资产长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将定期评估宏观经济的周期变化，结合资产估值水平，在股票、债券、现金等资产间进行合理配置，以期在满足基金资产安全性、流动性的前提下，尽可能地提高收益。 2、股票投资策略 本基金将采用自上而下的方法，根据宏观经济、政策面、资金面、市场情绪等因素，结合国内外宏观经济形势、国家产业政策、市场情绪、资金面、估值水平、流动性等因素，对股票市场进行中期趋势判断，并结合市场风格趋势分析，对股票市场的结构进行分析，在此基础上，通过定性与定量分析相结合的方法，自上而下地进行行业配置，并结合行业景气度、行业竞争格局、公司治理结构、盈利能力、成长性、估值水平等因素，自下而上地进行个股选择，以期获得超额收益。 3、固定收益投资策略 本基金将采用久期管理、收益率曲线、信用利差、息差、骑乘、期限结构、信用分析、可转债投资、可交换债投资、资产支持证券投资、国债期货、股指期货、利率互换、证券借贷、证券回购、现金管理等多种策略，在控制风险的前提下，以期获得较高的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益不低于债券型基金，高于货币型基金，是较为稳健的一类基金。
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属两类基金的简称情况	泰康均衡优选A份
下属两类基金的交易代码	004215
报告期末下属两类基金的份额总额	157,392,281.32份
报告期末下属两类基金的份额总额	0.00元

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	上海证券(A)	泰康均衡优选A(C)
		2019-04-01 - 2019-06-30
本期已实现收益		16,801,555.42
本期利润		11,121,558.28
加权平均基金份额本期利润		0.0142
期末基金资产净值		159,392,161.32
期末基金份额净值		1.0124

注：1）、本表金额按照四舍五入保留到小数点后第2位。

2）、本表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。

基金净值表现

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

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
过去一个月	5.94%	0.72%	1.42%	0.36%	4.52%	0.36%

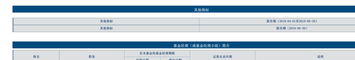
本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	5.94%	0.72%	1.42%	0.36%	4.52%	0.36%

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

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
过去一个月	5.94%	0.72%	1.42%	-0.04%	4.52%	0.76%

自基金合同生效日起基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金自基金合同生效日（2018-08-10）至今尚未开放申购。

2、业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%，指数编制机构未提供指数日收益率，故业绩比较基准收益率按照产品管理人的惯例计算方法计算。

自基金合同生效日起基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效日起基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

本报告期

单位：人民币元

报告期末	数量
报告期末	基金份额 (2019-04-01(2019-06-30))
报告期内	基金份额 (2019-04-01(2019-06-30))

§3 管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘沛霖	权益投资部经理	2019-01-18	-	11	刘沛霖于2010年5月加入泰康资产，曾任公司量化投资部研究员、组合管理助理、组合管理经理、权益投资部经理。2009年至2010年间，曾在国泰君安证券股份有限公司从事证券投资咨询业务。2008年至2009年间，曾在中国证券监督管理委员会上海证监局从事证券市场监管工作。2007年至2008年间，曾在上海证券交易所从事证券市场监管工作。2007年取得证券从业资格，2008年取得基金从业资格。2010年5月至今担任公司投资决策委员会委员，2013年6月至今担任公司量化投资决策委员会委员，2014年5月至今担任公司指数投资决策委员会委员，2014年5月至今担任公司主动权益投资决策委员会委员，2014年5月至今担任公司固定收益投资决策委员会委员，2014年5月至今担任公司资产配置决策委员会委员，2014年5