

泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2019-07-16

重要提示

基金管理人及基金托管人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。
基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月15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预示其未来表现，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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期为2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

项目	数值
基金名称	泰康瑞坤纯债债券
场内简称	
基金代码	000054
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017-12-27
报告期末基金份额总额	427,880,277.19
投资目标	在谨慎投资并严格控制风险的前提下，本基金力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将利用管理人多年宏观经济发展分析上的丰富经验和积累，通过基金管理人自身研发构建固定收益投资决策分析体系（PIFA系统）定期评估宏观经济和投资环境，并对全球及国内发展进行评估和展望。在定性或定量分析基础上，判断未来市场发展的主要推动因素，预测关键经济变量，针对宏观经济未来的预期情景，分别测算各类资产收益和风险并对各类资产未来收益的稳定性进行评估，结合市场情况和预期收益，拟定资产配置方案。 本基金通过市场上不同期限品种交易期限变化分析市场利率和期限上的投资偏好，并结合对利率走势的判断选择合适久期的债券品种进行投资。对于信用债投资，在中介机构信用评级比例确定之后进行个券选择，信用风险和流动性风险是影响个券相对价值的主要因素，根据国区经济运行预期情况，分析企业（公司）债券等发行人所处行业发展状况、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定情况的发行资料，评价债券的信用级别，选择具有相对价值且信用风险较低的企业（公司）债券进行投资。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低预期风险/收益的产品。
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

主要财务指标

主要财务指标	报告期（2019-04-01至2019-06-30）	单位：人民币元
本期已实现收益	-3,601,379.46	
本期利润	-2,064,893.50	
加权平均基金份额本期利润	0.0037	
期末基金资产净值	452,208,399.63	
期末基金份额净值	1.0599	

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）和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）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际投资水平要低于所列数字。

基金净值表现

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

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
过去三个月	-0.07%	0.06%	0.63%	0.06%	-0.72%	0.00%

本期国债期货投资评价	
------------	--