

泰康安益纯债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 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

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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 2017 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告..... | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 36 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 36 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 36 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 36 |
| 7.6 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..... | 37 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 37 |
| 7.8 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..... | 37 |
| 7.9 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..... | 37 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 38 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 38 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 40 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 40 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 40 |
| 8.3 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..... | 40 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 41 |
| §10 重大事件揭示..... | 42 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 42 |
| 10.2 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..... | 42 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 42 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 42 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 42 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 42 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 42 |
| 10.8 其他重大事件..... | 43 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 44 |
| 11.1 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..... | 44 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 44 |

| | |
|-------------------------|-----------|
| §12 备查文件目录 | 45 |
| 12.1 备查文件目录..... | 45 |
| 12.2 存放地点..... | 45 |
| 12.3 查阅方式..... | 45 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|--------------|
| 基金名称 | 泰康安益纯债债券型证券投资基金 | |
| 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 | 366,328,017.96 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 | 366,213,780.41 份 | 114,237.55 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 | 周峰 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 010-57691941 | 010-58560666 |
| | 电子邮箱 | zhoufengl@taikangamc.com.cn | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4001895522 | 95568 |
| 传真 | | 010-66429136 | 010-58560798 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号 |
| 办公地址 | | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号 |

| | | |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码 | 100033 | 100031 |
| 法定代表人 | 段国圣 | 洪崎 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|--------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.tkfunds.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人办公地、基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|--------------------------|
| 注册登记机构 | 泰康资产管理有限责任公司 | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别 | 泰康安益纯债债券 A | 泰康安益纯债债券 C |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日) | 报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 2,808,629.45 | 643.76 |
| 本期利润 | 4,703,445.36 | 1,299.33 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0121 | 0.0102 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.21% | 0.90% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.28% | 1.14% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 217,173.42 | 15,301.47 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0006 | 0.1339 |
| 期末基金资产净值 | 368,300,940.40 | 130,202.36 |
| 期末基金份额净值 | 1.0057 | 1.1398 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.57% | 13.98% |

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

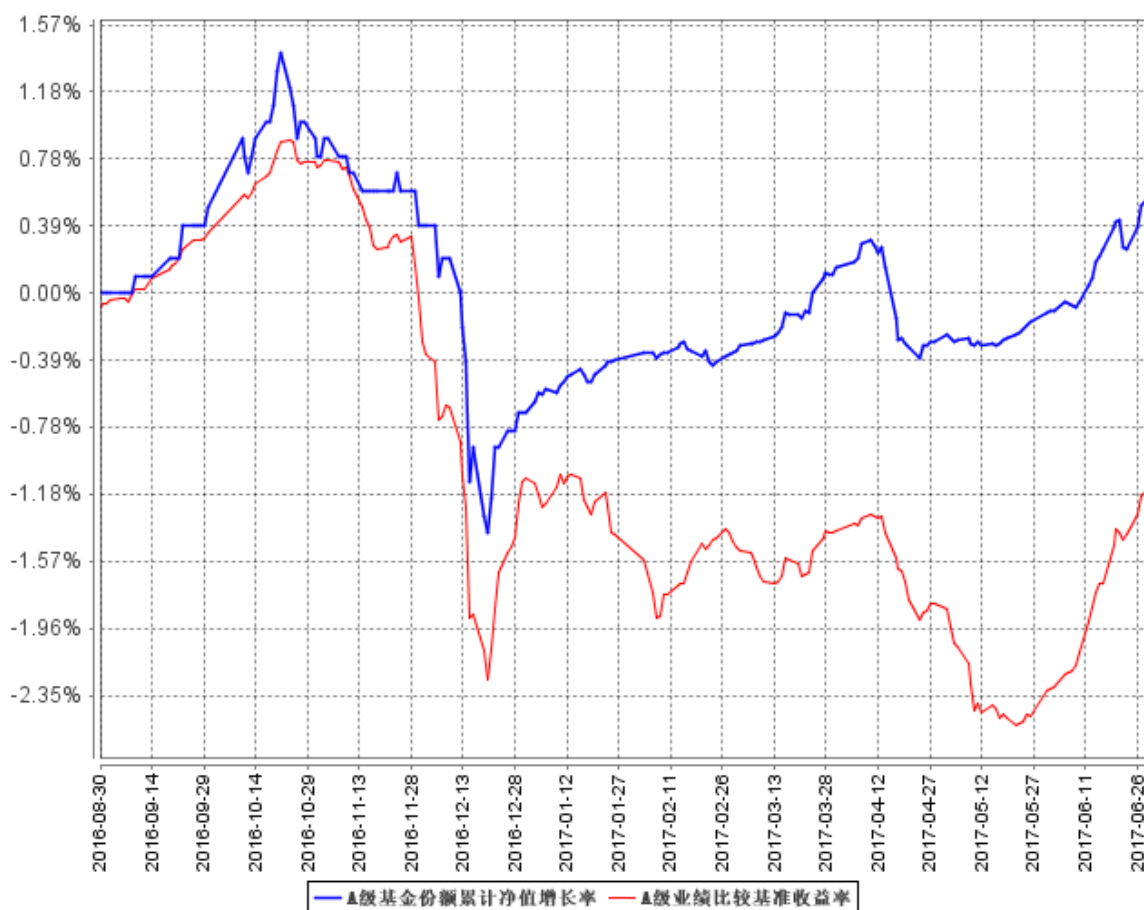
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.68% | 0.06% | 1.17% | 0.07% | -0.49% | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.42% | 0.07% | 0.22% | 0.08% | 0.20% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.28% | 0.05% | -0.09% | 0.07% | 1.37% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.57% | 0.10% | -1.17% | 0.10% | 1.74% | 0.00% |

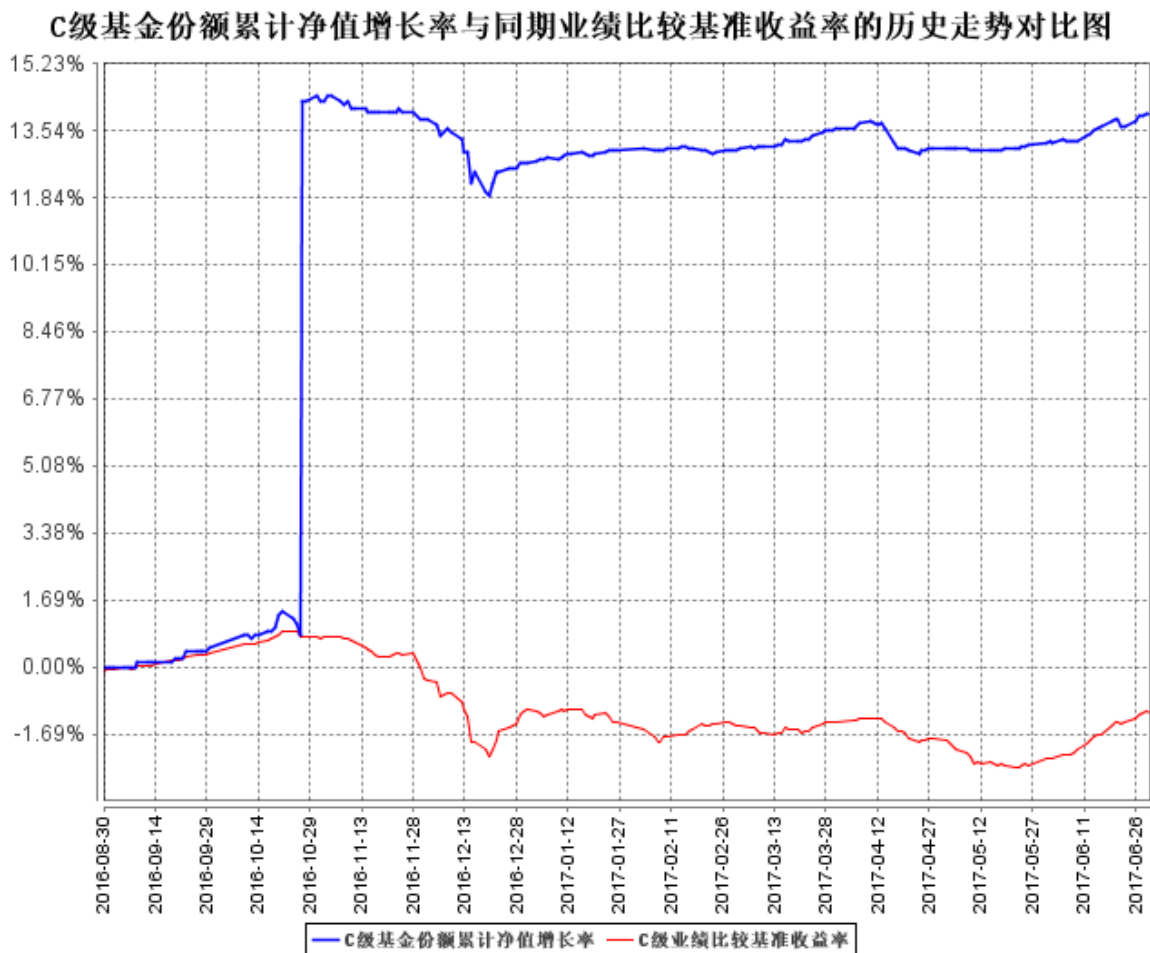
泰康安益纯债债券 C

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.66% | 0.06% | 1.17% | 0.07% | -0.51% | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.35% | 0.07% | 0.22% | 0.08% | 0.13% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.14% | 0.05% | -0.09% | 0.07% | 1.23% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.98% | 0.95% | -1.17% | 0.10% | 15.15% | 0.85% |

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，截至报告期末未满一年。
 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。

§ 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。截至2015年底,公司注册资本为10亿元,净资产超过56亿元。

截至2016年底,泰康受托资产管理规模破万亿。除管理母公司泰康保险集团股份有限公司委托资产外,泰康资产第三方业务规模突破5000亿元。其中,截至2016年6月30日,泰康资产企业年金投资管理规模突破1200亿元,位居企业年金投资管理人规模第二名。

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。2016年12月,泰康资产入选基本养老保险基金证券投资管理机构。

截至2017年6月30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共15只证券投资基金。

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 | 本基金经理 | 2016年8月30日 | - | 8 | 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 日起至今担任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。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。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。 |
|--|--|--|--|--|---|

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。

4.3.2 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 年上半年，宏观经济走势平稳中有所复苏，一季度和上半年 GDP 均为 6.9%，较去年有小幅回升。结构上看，受全球经济复苏的影响，出口改善明显；内需上，零售保持平稳，而投资增速则有小幅上行。上半年财政政策积极，货币政策稳健中性，金融监管明显加强。物价方面，CPI 低位平稳，PPI 从高位有所回落，总体通胀压力有所缓和。汇率方面，受到特朗普新政不及预期、欧央行退出宽松的预期升温等因素的影响，美元震荡走弱，人民币保持相对稳定。

债券市场方面，一季度受到美联储加息的影响，中国两次上调公开市场利率，带动收益率震荡上行。进入二季度，受到金融监管加强的影响，叠加货币政策边际趋紧，资金面较为紧张，导致收益率上行；随后监管协调加强，叠加人民币升值，货币政策转为稳健中性，资金面较为平稳，利率在震荡中有所下行。

报告期内，基金整体维持高等级中低久期策略。一季度债券利率先上后下，随着央行两次上调公开市场操作利率，以及季末 MPA 考核带来的资金面冲击，我们认为债券利率已初具配置价值，轻仓参与了长债的波段交易。二季度金融去杠杆政策趋严，金融机构自查导致债券抛售潮，债券尤其是低等级信用债利率大幅上行。直到 6 月初，我们认为利率债和高等级信用债已初具配置价值，同时央行对市场流动性的呵护，以及监管协调性的加强，让我们相信市场可能已经阶段性见底，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

泰康安益纯债债券 A

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0057，本报告期份额净值增长率为 1.28%，同期业绩比较基准增长率为-0.09%。

泰康安益纯债债券 C

截止报告期末，本基金份额净值为 1.1398，本报告期份额净值增长率为 1.14%，同期业绩比较基准增长率为-0.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在外需改善、内需自身动能较强的背景下，经济增长韧性较强。政策方面，预计仍将维持稳健中性的货币政策，监管政策将更加协调有序。从外部环境看，资本外流的压力明显减小，在美元走弱的背景下，人民币汇率料将保持稳定，需关注美联储加息和缩表、欧央行退出 QE 等因素带来的扰动及其影响。

债券市场方面，短期而言需要关注经济基本面韧性持续超预期所带来的 PPI 环比转正的影响。

中期而言，欧央行缩减 QE 是否会造成全球流动性的收紧，需要密切留意。另外，强监管背景下，部分民营企业的信用风险事件也需要高度重视。基金的固收投资将整体保持偏低久期，着重挖掘个券阿尔法机会。

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、权益投资部、资产管理部、固定收益投资中心、金融产品投资小组、国际投资部、股权投资部、投后管理部、运营管理部等。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遵规守信情况声明

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遵规守信、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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 6,140,094.50 | 4,319,424.57 |
| 结算备付金 | | 1,678,247.53 | 1,220,321.78 |
| 存出保证金 | | - | 986,704.12 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 296,201,000.00 | 353,263,443.50 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 296,201,000.00 | 353,263,443.50 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 124,200,000.00 | 99,890,469.84 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 4,814,827.88 | 4,793,096.21 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 994.04 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 433,034,169.91 | 464,474,454.06 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 58,199,712.70 | 59,999,710.00 |
| 应付证券清算款 | | 5,945,753.42 | - |
| 应付赎回款 | | 10,885.85 | - |
| 应付管理人报酬 | | 180,965.62 | 212,568.83 |
| 应付托管费 | | 45,241.45 | 53,142.24 |
| 应付销售服务费 | | 35.14 | 66.59 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 22,141.61 | 26,939.94 |
| 应交税费 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息 | | 10,765.38 | 10,501.16 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 187,525.98 | 126,600.00 |
| 负债合计 | | 64,603,027.15 | 60,429,528.76 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 366,328,017.96 | 406,762,304.04 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 2,103,124.80 | -2,717,378.74 |
| 所有者权益合计 | | 368,431,142.76 | 404,044,925.30 |
| 负债和所有者权益总计 | | 433,034,169.91 | 464,474,454.06 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0057 元，C 类基金份额净值 1.1398 元；基金份额总额 366,328,017.96 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 366,213,780.41 份，C 类基金份额总额 114,237.55 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|
| 一、收入 | | 7,065,416.94 |
| 1.利息收入 | | 8,056,103.59 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 24,751.86 |
| 债券利息收入 | | 7,775,194.54 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 256,157.19 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -2,896,324.62 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -2,312,274.62 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | -584,050.00 |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 1,895,471.48 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 10,166.49 |
| 减：二、费用 | | 2,360,672.25 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,160,316.37 |

| | | |
|----------------------------|------------|---------------------|
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 290,079.16 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 213.59 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 18,493.86 |
| 5. 利息支出 | | 680,387.22 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 680,387.22 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 211,182.05 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 4,704,744.69 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 4,704,744.69 |

注：本基金合同生效日为 2016 年 8 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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） | - | 4,704,744.69 | 4,704,744.69 |
| 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） | -40,434,286.08 | 115,758.85 | -40,318,527.23 |
| 其中：1.基金申购款 | 391,347.04 | 19,651.21 | 410,998.25 |
| 2.基金赎回款 | -40,825,633.12 | 96,107.64 | -40,729,525.48 |
| 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） | 366,328,017.96 | 2,103,124.80 | 368,431,142.76 |

注：本基金合同生效日为 2016 年 8 月 30 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|-----------|-----------|
| <u>段国圣</u> | <u>魏宇</u> | <u>李红</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

6.4.2 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》、《泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间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 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款 | 6,140,094.50 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 6,140,094.50 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 | | |
|-------------------|-------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | 294,956,378.70 | 296,201,000.00 |
| | 合计 | 294,956,378.70 | 296,201,000.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 294,956,378.70 | 296,201,000.00 | 1,244,621.30 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 | |
|------------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券-交易所 | 124,200,000.00 | - |
| 买入返售证券-银行间 | - | - |
| 合计 | 124,200,000.00 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 3,984.49 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 868.60 |
| 应收债券利息 | 4,837,975.24 |
| 应收买入返售证券利息 | -28,000.45 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 4,814,827.88 |

6.4.7.6 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 22,141.61 |
| 合计 | 22,141.61 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 7.49 |
| 预提费用 | 187,518.49 |
| 合计 | 187,525.98 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰康安益纯债债券 A

第 22 页 共 45 页

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 406,698,298.79 | 406,698,298.79 |
| 本期申购 | 237,599.32 | 237,599.32 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -40,722,117.70 | -40,722,117.70 |
| 本期末 | 366,213,780.41 | 366,213,780.41 |

金额单位：人民币元

| 泰康安益纯债债券 C | | |
|---------------|----------------------------|-------------|
| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 64,005.25 | 64,005.25 |
| 本期申购 | 153,747.72 | 153,747.72 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -103,515.42 | -103,515.42 |
| 本期末 | 114,237.55 | 114,237.55 |

本期申购包含红利再投资、基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 泰康安益纯债债券 A | | | |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | -2,612,760.83 | -112,772.79 | -2,725,533.62 |
| 本期利润 | 2,808,629.45 | 1,894,815.91 | 4,703,445.36 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 21,304.80 | 87,943.45 | 109,248.25 |
| 其中：基金申购款 | -697.76 | 151.14 | -546.62 |
| 基金赎回款 | 22,002.56 | 87,792.31 | 109,794.87 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 217,173.42 | 1,869,986.57 | 2,087,159.99 |

单位：人民币元

| 泰康安益纯债债券 C | | | |
|----------------|------------|---------|------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 8,174.29 | -19.41 | 8,154.88 |
| 本期利润 | 643.76 | 655.57 | 1,299.33 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 6,483.42 | 27.18 | 6,510.60 |
| 其中：基金申购款 | 20,059.69 | 138.14 | 20,197.83 |
| 基金赎回款 | -13,576.27 | -110.96 | -13,687.23 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 15,301.47 | 663.34 | 15,964.81 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 8,687.75 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 16,000.47 |
| 其他 | 63.64 |
| 合计 | 24,751.86 |

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期，本基金无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -2,312,274.62 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -2,312,274.62 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,175,016,708.98 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,159,390,581.87 |
| 减：应收利息总额 | 17,938,401.73 |
| 买卖债券差价收入 | -2,312,274.62 |

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----------|--------------------------------|
| 国债期货投资收益 | -584,050.00 |
| 合计 | -584,050.00 |

6.4.7.16 股利收益

本报告期，本基金无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 2,041,421.48 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 2,041,421.48 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | -145,950.00 |
| ——权证投资 | - |
| ——期货投资 | -145,950.00 |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 1,895,471.48 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 10,141.39 |
| 基金转换费收入 | 25.10 |
| 合计 | 10,166.49 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金转换费用由申购费补差和转出基金赎回费两部分构成。其中：申购费补差收取具体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 543.86 |
| 银行间市场交易费用 | 17,950.00 |
| 合计 | 18,493.86 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 其他 | 600.00 |
| 债券帐户维护费 | 27,000.00 |
| 银行费用 | 5,063.56 |
| 合计 | 211,182.05 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,160,316.37 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,932.96 |

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 X 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 290,079.16 |

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 X 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.1 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 | | |
|----------------|---------------------------------|------------|-------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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 |
| 泰康资产管理有限责任公司 | - | 33.38 | 33.38 |
| 合计 | - | 33.38 | 33.38 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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 |
|--|---------------|------------|----|

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.10.4.2 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 2017 年 6 月 30 日 | | 上年度末 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 | 49.18% |

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。

6.4.10.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | |
|-----------|---------------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 民生银行 | 6,140,094.50 | 8,687.75 |

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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 6 月 30 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。

6.4.12.2 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 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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 58,199,712.7 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 |
|--------|----------|----------------|--------|---------|---------------|
| 160210 | 16 国开 10 | 2017 年 7 月 6 日 | 91.89 | 300,000 | 27,567,000.00 |
| 100408 | 10 农发 08 | 2017 年 7 月 6 日 | 99.99 | 200,000 | 19,998,000.00 |
| 170202 | 17 国开 02 | 2017 年 7 月 6 日 | 95.66 | 100,000 | 9,566,000.00 |
| 合计 | | | | 600,000 | 57,131,000.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制订了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行民生银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计

及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2017年6月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 20,008,000.00 | 29,924,000.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 190,719,000.00 | 179,252,000.00 |
| 合计 | 210,727,000.00 | 209,176,000.00 |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2017年6月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 18,505,000.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 18,505,000.00 | 0.00 |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余可在证券交易所上市交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 58,199,712.70 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|----------------|---------------|---------------|-----|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 6,140,094.50 | - | - | - | 6,140,094.50 |
| 结算备付金 | 1,678,247.53 | - | - | - | 1,678,247.53 |
| 交易性金融资产 | 230,725,000.00 | 18,505,000.00 | 46,971,000.00 | - | 296,201,000.00 |

| | | | | | |
|---------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 买入返售金融资产 | 124,200,000.00 | - | - | - | 124,200,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 4,814,827.88 | 4,814,827.88 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 362,743,342.03 | 18,505,000.00 | 46,971,000.00 | 4,814,827.88 | 433,034,169.91 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 58,199,712.70 | - | - | - | 58,199,712.70 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 5,945,753.42 | 5,945,753.42 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 10,885.85 | 10,885.85 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 180,965.62 | 180,965.62 |
| 应付托管费 | - | - | - | 45,241.45 | 45,241.45 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 35.14 | 35.14 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 22,141.61 | 22,141.61 |
| 应付利息 | - | - | - | 10,765.38 | 10,765.38 |
| 其他负债 | - | - | - | 187,525.98 | 187,525.98 |
| 负债总计 | 58,199,712.70 | - | - | 6,403,314.45 | 64,603,027.15 |
| 利率敏感度缺口 | 304,543,629.33 | 18,505,000.00 | 46,971,000.00 | -1,588,486.57 | 368,431,142.76 |
| 上年度末 2016年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 4,319,424.57 | - | - | - | 4,319,424.57 |
| 结算备付金 | 1,220,321.78 | - | - | - | 1,220,321.78 |
| 存出保证金 | 13,404.12 | - | - | 973,300.00 | 986,704.12 |
| 交易性金融资产 | 262,672,443.50 | 90,591,000.00 | - | - | 353,263,443.50 |
| 买入返售金融资产 | 99,890,469.84 | - | - | - | 99,890,469.84 |
| 应收利息 | - | - | - | 4,793,096.21 | 4,793,096.21 |
| 应收申购款 | 994.04 | - | - | - | 994.04 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 368,117,057.85 | 90,591,000.00 | - | 5,766,396.21 | 464,474,454.06 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 59,999,710.00 | - | - | - | 59,999,710.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 212,568.83 | 212,568.83 |
| 应付托管费 | - | - | - | 53,142.24 | 53,142.24 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 66.59 | 66.59 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 26,939.94 | 26,939.94 |
| 应付利息 | - | - | - | 10,501.16 | 10,501.16 |
| 其他负债 | - | - | - | 126,600.00 | 126,600.00 |
| 负债总计 | 59,999,710.00 | - | - | 429,818.76 | 60,429,528.76 |
| 利率敏感度缺口 | 308,117,347.85 | 90,591,000.00 | - | 5,336,577.45 | 404,044,925.30 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--|---------------------------------|-------------------|
| 假设 | 假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2017年6月30日） | 上年度末（2016年12月31日） |
| | 市场利率下调0.25% | 1,273,373.00 | 517,192.57 |
| | 市场利率上调0.25% | -1,242,815.80 | -515,131.20 |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无其他重大价格风险。

6.4.14 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6月30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296,201,000元，无属于第三层次的余额（2016年12月31日，属于第二层次的余额为353,263,443.50元，无属于第一和第三层次的余额）。

(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 6 月 30 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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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 | 296,201,000.00 | 68.40 |
| | 其中：债券 | 296,201,000.00 | 68.40 |
| | 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 | 124,200,000.00 | 28.68 |
| | 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 | 7,818,342.03 | 1.81 |
| 7 | 其他各项资产 | 4,814,827.88 | 1.11 |
| 8 | 合计 | 433,034,169.91 | 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。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金报告期内未持有境内股票。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

注：本基金报告期内未持有股票。

7.4.2 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

注：本基金报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金报告期内未持有股票。

7.5 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 | 66,969,000.00 | 18.18 |
| | 其中：政策性金融债 | 66,969,000.00 | 18.18 |
| 4 | 企业债券 | 8,270,000.00 | 2.24 |
| 5 | 企业短期融资券 | 210,727,000.00 | 57.20 |
| 6 | 中期票据 | 10,235,000.00 | 2.78 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 296,201,000.00 | 80.40 |

7.6 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 | 160210 | 16 国开 10 | 300,000 | 27,567,000.00 | 7.48 |
| 2 | 011697045 | 16 富兴 SCP004 | 200,000 | 20,158,000.00 | 5.47 |
| 3 | 011698847 | 16 大同煤矿 SCP004 | 200,000 | 20,092,000.00 | 5.45 |
| 4 | 011698571 | 16 中铝业 SCP011 | 200,000 | 20,088,000.00 | 5.45 |
| 5 | 011698800 | 16 鲁钢铁 SCP009 | 200,000 | 20,078,000.00 | 5.45 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

根据风险管理原则，本基金以套期保值为主要目的进行国债期货投资。通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现券资产进行匹配，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-------------|
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | -584,050.00 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -145,950.00 |

7.10.3 本期国债期货投资评价

在进行了全面而深入的定性与定量分析后，本基金本报告期国债期货套期保值操作较好地对冲了利率风险、流动性风险对基金的影响，降低了基金净值的波动，取得了预期的对冲效果。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 本基金本报告期内未持有股票。

7.11.3 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,814,827.88 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,814,827.88 |

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.11.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 | 162 | 2,260,578.89 | 364,645,351.40 | 99.57% | 1,568,429.01 | 0.43% |
| 泰康安益纯债债券 C | 34 | 3,359.93 | 0.00 | 0.00% | 114,237.55 | 100.00% |
| 合计 | 196 | 1,869,020.50 | 364,645,351.40 | 99.54% | 1,682,666.56 | 0.46% |

8.2 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 | 999.54 | 0.0003% |
| | 泰康安益纯债债券 C | 437.45 | 0.3829% |
| | 合计 | 1,436.99 | 0.0004% |

8.3 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 |

§ 9 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 | 237,599.32 | 153,747.72 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 40,722,117.70 | 103,515.42 |
| 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 | 366,213,780.41 | 114,237.55 |

报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

10.3 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、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 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，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

注：（1）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度

保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

(2) 本报告期内本基金交易单元未发生变更。

10.7.2 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 |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 346,400,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|--------------------------|-----------|
| 1 | 泰康资产管理有限责任公司关于直销电子交易系统增加北京农商银行卡通联通道快捷支付渠道并实施费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2017年1月9日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 | 20170419-20170630 | 74,465,325.67 | - | - | 74,465,325.67 | 20.33% |
| | 2 | 20170101-20170630 | 199,999,000.00 | - | - | 199,999,000.00 | 54.60% |
| 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康安益纯债债券型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康安益纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康安益纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康安益纯债债券型证券投资基金托管协议》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录基金管理人互联网网址（<http://www.tkfunds.com.cn>）查阅。

泰康资产管理有限责任公司

2017 年 8 月 28 日