

泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人北京银行股份有限公司(以下简称“北京银行”)根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 29 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰康新回报灵活配置混合	
基金主代码	001798	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 9 月 23 日	
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	400,944,951.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码:	001798	001799
报告期末下属分级基金的份额总额	144,715,956.16 份	256,228,994.93 份

2.2 基金产品说明

投资目标	积极灵活配置资产，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。
投资策略	本基金采取定性分析与定量分析相结合的分析框架，通过自上而下的方法精选投资标的，灵活配置大类资产，在控制风险的前提下进行投资管理，力争利用主动式组合管理获得超过业绩比较基准的收益。 具体来看，本基金综合考虑多种因素，对国内外宏观经济形势与政策、市场利率走势、信用利差水平、利率期限结构以及证券市场走势等因素进行分析，在本基金合同约定范围内制定合理的资产配置计划。
业绩比较基准	30%*沪深 300 指数收益率+65%*中债新综合财富（总值）指数收益率+5%*金融机构人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张叶	刘晔
	联系电话	010-57697372	010-66225275
	电子邮箱	zhangye20@taikangamc.com.cn	qichaol@bankofbeijing.com
客户服务电话		4001895522	95526
传真		010-66429136	010-66225309

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	2016 年		2015 年 9 月 23 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C
本期已实现收益	7,291,129.90	5,240,880.00	1,050,732.98	607,593.58
本期利润	7,512,501.27	2,302,488.91	1,160,935.43	852,634.29
加权平均基金份额本期利润	0.0455	0.0132	0.0071	0.0068
本期基金份额净值增长率	4.57%	4.17%	0.70%	0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0505	0.0458	0.0065	0.0056
期末基金资产净值	152,374,149.06	268,597,902.84	166,434,211.64	112,513,234.29
期末基金份额净值	1.053	1.048	1.007	1.006

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

泰康新回报灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	--------------	-----	-----

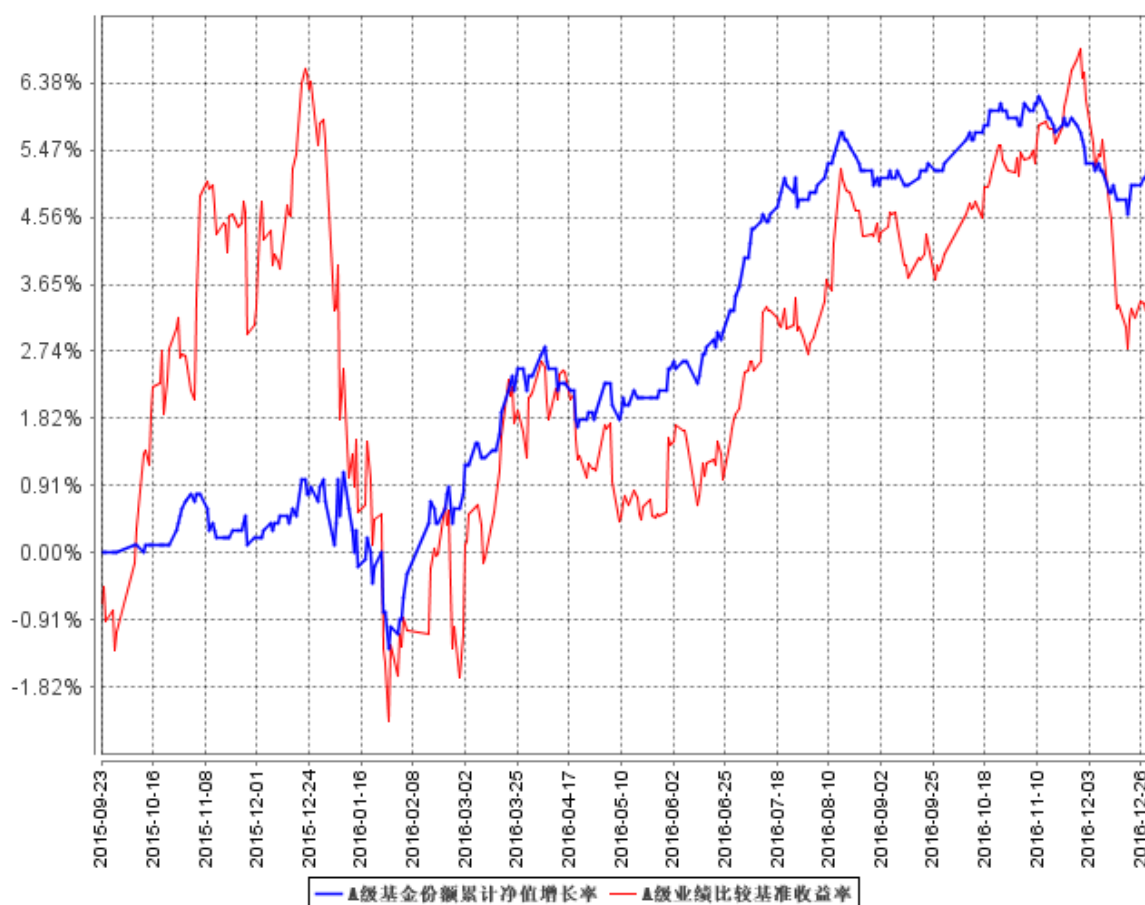
		准差②	率③	④		
过去三个月	0.00%	0.11%	-0.43%	0.26%	0.43%	-0.15%
过去六个月	1.74%	0.11%	1.70%	0.25%	0.04%	-0.14%
过去一年	4.57%	0.19%	-1.87%	0.43%	6.44%	-0.24%
自基金合同生效起至今	5.30%	0.18%	3.62%	0.44%	1.68%	-0.26%

泰康新回报灵活配置混合 C

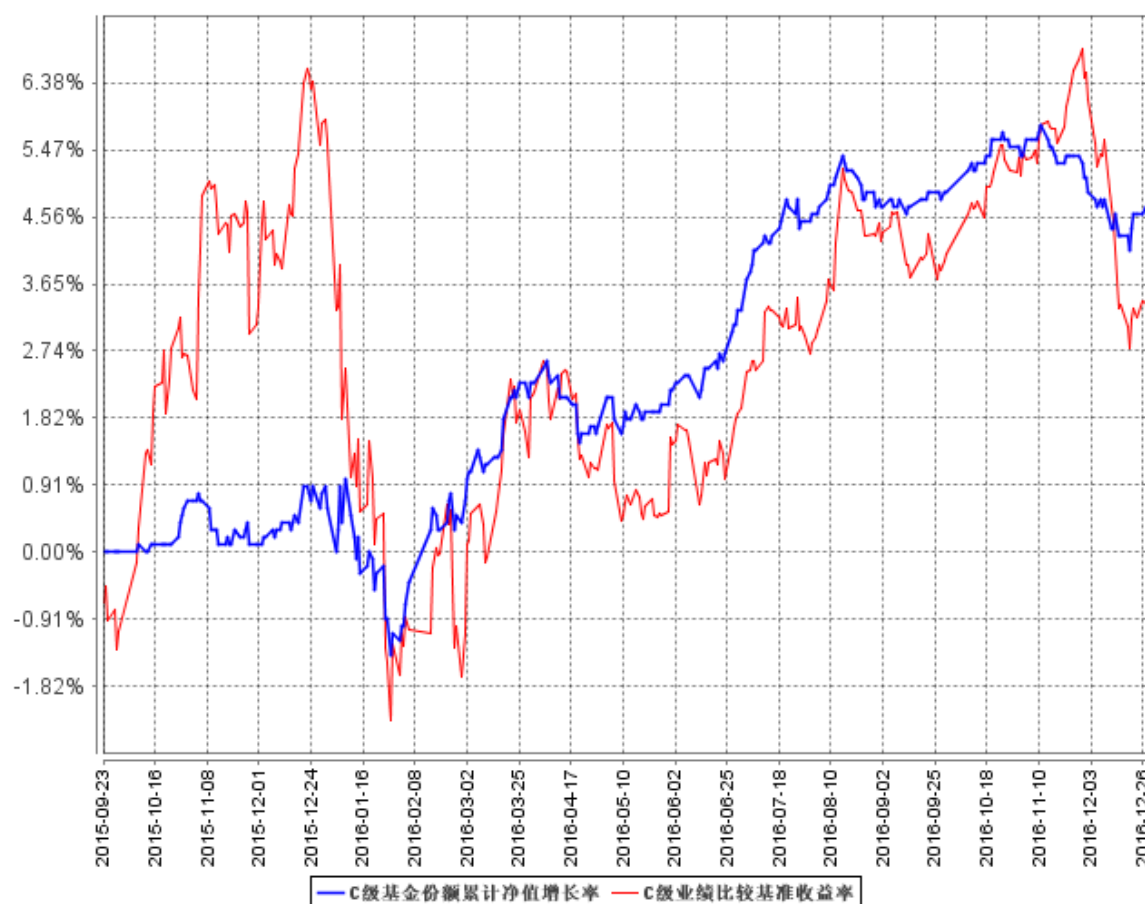
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.10%	0.12%	-0.43%	0.26%	0.33%	-0.14%
过去六个月	1.45%	0.12%	1.70%	0.25%	-0.25%	-0.13%
过去一年	4.17%	0.18%	-1.87%	0.43%	6.04%	-0.25%
自基金合同生效起至今	4.80%	0.17%	3.62%	0.44%	1.18%	-0.27%

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



C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

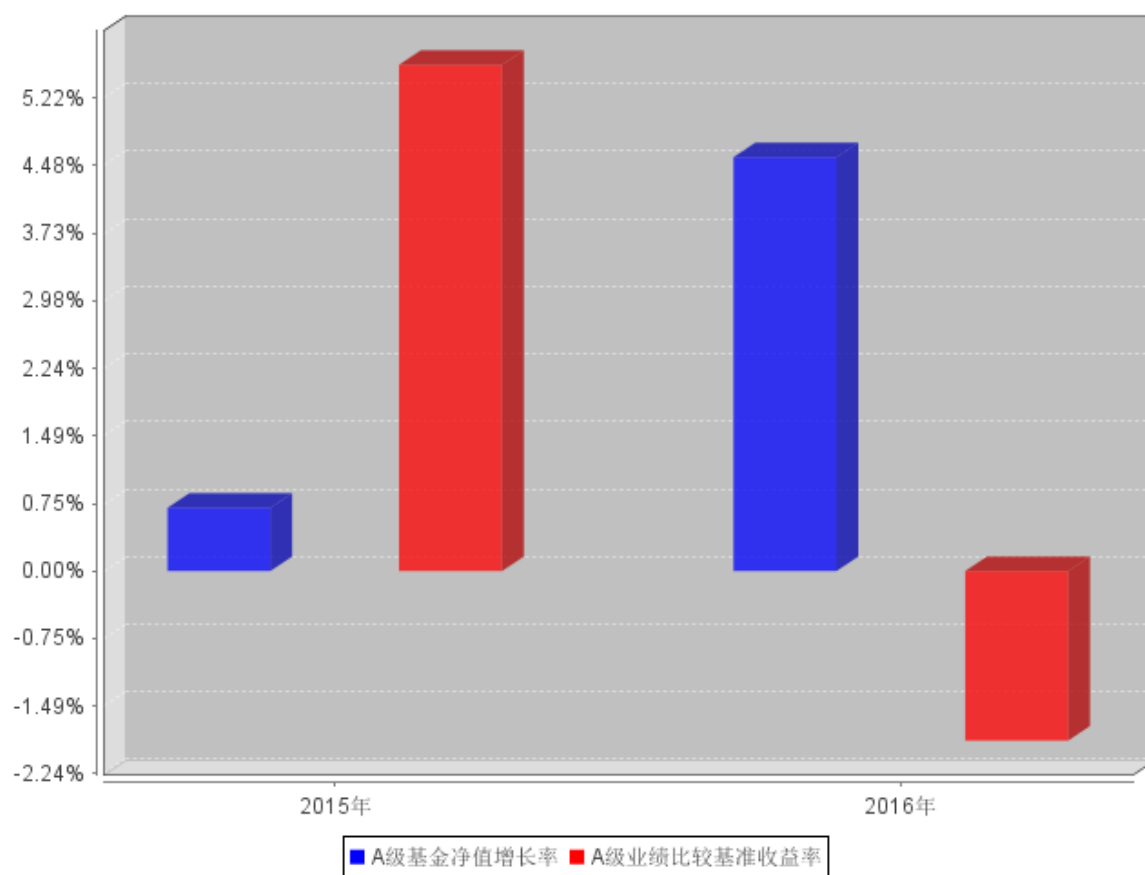


注：1、本基金基金合同于 2015 年 9 月 23 日生效。

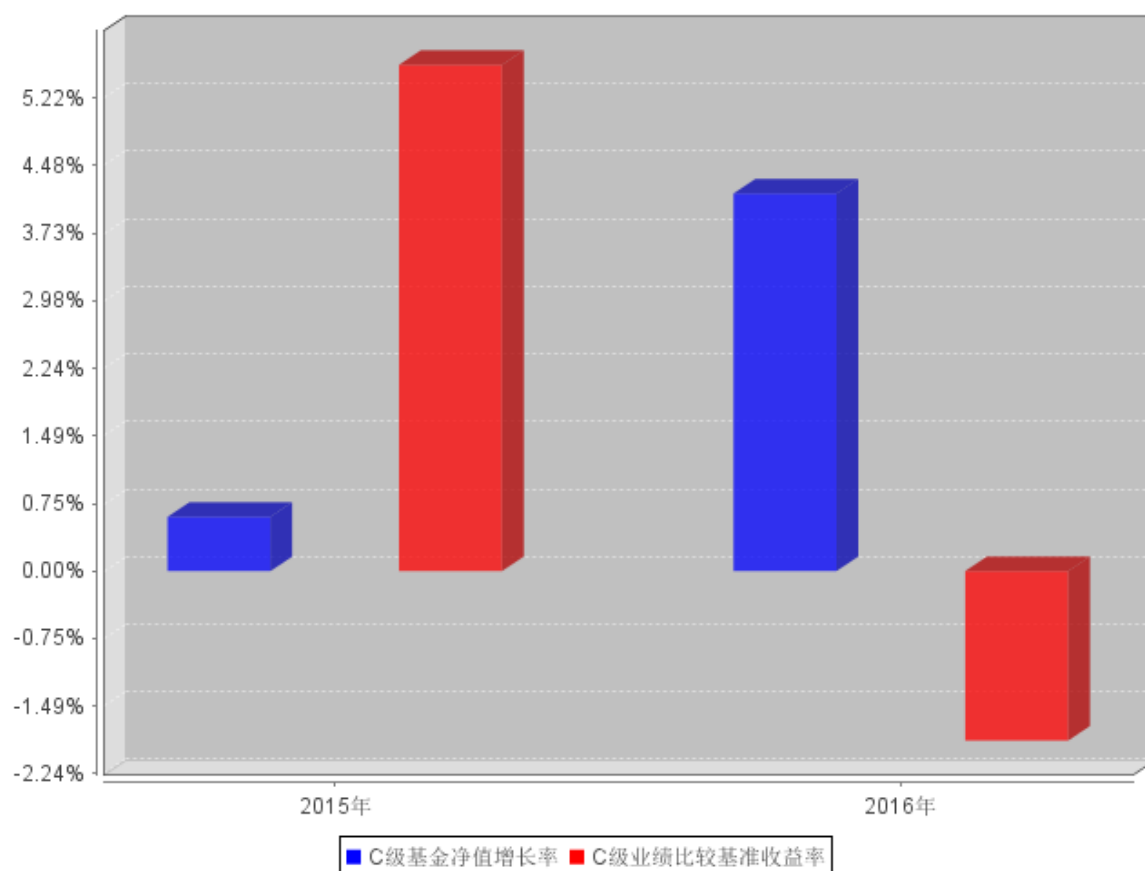
2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

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 2015 年 9 月 23 日，2015 年度净值增长率的计算期间为 2015 年 9 月 23 日至 2015 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（2015 年 9 月 23 日）至报告期截止日（2016 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。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基金管理机构。

截至 2016 年底，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共十三只证券投资基金。

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		
彭一博	本基金基金经理	2015 年 11 月 2 日	—	7	彭一博于 2015 年 7 月加入泰康资产管理有限责任公司，担任公募事业部投资部股票投资总监。曾在华夏基金管理有限公司担任行业研究员、基金经理助理，2012 年 1 月 12 日至 2014 年 5 月 29 日担任兴和证券投资基金基金经理，2014 年 5 月至 2015 年 6 月任华夏兴和混合型证券投资基金基金经理。2015 年 11 月 2 日至今任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 23 日至今任泰康安泰回报混合型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月 6 日起至今任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资

					资基金基金经理。2016 年 8 月 24 日至今担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 21 日至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 29 日至今担任泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
蒋利娟	本基金基金经理	2015 年 9 月 23 日	-	8	蒋利娟女士，经济学硕士。2008 年 7 月加入泰康资产管理有限责任公司，历任集中交易室交易员，固定收益投资部流动性投资经理、固定收益投资经理，固定收益投资中心固定收益投资经理，2015 年 6 月 19 日至今担任泰康薪意保货币市场基金基金经理。2015 年 9 月 23 日至今担任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 8 日至 2016 年 12 月 26 日任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 2 月 3 日至今任泰康稳健增利债券型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月 8 日至今任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。

注：1、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、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

2016 年全年，宏观经济平稳运行，四个季度的 GDP 增速分别是 6.7、6.7、6.7、6.8。具体来看，基建投资增速前高后低，制造业投资企稳回升，全年投资较为平稳；零售增速保持平稳，进

出口有所改善，企业进入到补库存阶段。CPI 较为温和，PPI 上行较快，从 0 以下回升到 5.5%。央行的货币政策总体稳健中性，四季度中性略偏紧，流动性保持在合理水平。汇率方面，受美联储加息、美元指数上行等因素的影响，人民币有所贬值。

债券市场方面，收益率前期区间震荡，10 月底开始有较大幅度的上行。具体来看，年初由于天量社融和稳增长的预期，收益率有所下行；年中随着供给侧改革、资金面较宽松、资产荒等因素，收益率震荡下行；四季度由于通胀预期升温、资金面波动、市场预期美联储未来加快加息等因素，收益率快速上行。全年来看，10Y 国债上行 20bp，10Y 国开上行 50bp。

权益市场方面，A 股开年大跌超 20%，熔断机制暂停。弱势整理后，受到国内外政策面呵护，风险偏好提升的影响，A 股总体呈现震荡上行趋势。二、三季度市场呈现震荡格局，部分行业 and 个股表现活跃。四季度市场呈现冲高回落、略有涨幅的格局，其中建筑、钢铁、石化等行业表现较好。

报告期内，一季度在债券市场整体收益率较低的情况下，基金保持了中性偏低的久期和适度的杠杆水平。二、三季度，适时进行了利率债的波段操作。10 月份中下旬开始，在宏观经济指标有所向好、通胀预期有所升温、货币政策有所收紧等背景下，基金主要对持仓金融债及时获利了结，快速降低了组合久期及杠杆，有效规避了 11 月-12 月的债市下跌。权益投资方面，基金采取了较为谨慎的投资策略，严控组合整体风险，有效规避了年初市场的剧烈波动。之后，基金对有色金属、农林牧渔、食品饮料等行业和个股进行了阶段性投资，较为有效的规避了市场波动，获取了一定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

泰康新回报灵活配置混合 A

截止报告期末，本基金份额净值为 1.053，本报告期份额净值增长率为 4.57%，同期业绩比较基准增长率为-1.87%。

泰康新回报灵活配置混合 C

截止报告期末，本基金份额净值为 1.048，本报告期份额净值增长率为 4.17%，同期业绩比较基准增长率为-1.87%。

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 2017 年，经济内生增长的动能有所回升，企业利润随着 PPI 回升有显著改善。政策方面，预计仍将维持相对积极的财政政策和稳健中性的货币政策。从外部环境看，须关注美联储加息、特朗普政策带来的市场影响。

债券市场方面，预计利率水平将受到多方面因素的影响，其中国内外经济基本面及通胀走势尤其要密切关注。本基金未来债券仓位和久期将继续保持中性水平，注重组合持有期收益，适当参与利率债的波段操作机会。品种方面，配置以利率债及中高等级信用债为主，控制组合信用风险。

权益市场方面，2017 年市场将呈现机会与风险并存的格局。当前经济处于增速较高的状态，企业盈利能力也明显得到了恢复，这些有利因素将为股市上涨提供动力。同时，通胀水平和市场利率水平正在上升，部分股票的估值水平仍然处于历史相对高位，这些因素对股市全年的行情将产生潜在不利影响。我们将紧密跟踪经济和市场的动态变化，力争把握机会、规避风险，为基金持有人取得较好回报。

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

在本报告期内，本基金托管人在托管泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

本基金 2016 年年度报告经普华永道中天会计师事务所有限公司（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：泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	82,489.06	22,194.54
结算备付金	5,612,069.77	6,368,117.65
存出保证金	184,008.38	126,816.02
交易性金融资产	436,314,034.55	309,123,909.51
其中：股票投资	48,652,912.95	26,234,909.91

基金投资	-	-
债券投资	387,661,121.60	282,888,999.60
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	39,600,259.40	50,000,195.00
应收证券清算款	19,240.49	10,552,359.45
应收利息	5,493,173.41	2,088,240.98
应收股利	-	-
应收申购款	5,098.20	1,071,410.51
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	487,310,373.26	379,353,243.66
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债:		
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	64,999,702.50	99,809,650.28
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	397,140.77	1,989.01
应付管理人报酬	402,973.75	270,453.15
应付托管费	60,446.06	40,567.97
应付销售服务费	106,475.09	52,257.57
应付交易费用	86,043.07	152,739.49
应交税费	-	-
应付利息	15,620.64	18,135.26
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	269,919.48	60,005.00
负债合计	66,338,321.36	100,405,797.73
所有者权益:		
实收基金	400,944,951.09	277,069,876.00
未分配利润	20,027,100.81	1,877,569.93
所有者权益合计	420,972,051.90	278,947,445.93
负债和所有者权益总计	487,310,373.26	379,353,243.66

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.053 元，C 类份额净值 1.048 元；基金份额总额 400,944,951.09 份。下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 144,715,956.16 份；C 类基金份额总额 256,228,994.93 份。

7.2 利润表

会计主体：泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 9 月 23 日(基金合同 生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	17,331,140.33	3,893,298.95
1.利息收入	13,243,298.73	2,737,944.42
其中：存款利息收入	52,364.94	759,731.19
债券利息收入	11,865,414.83	1,882,983.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,325,518.96	95,229.52
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	6,687,339.58	742,292.66
其中：股票投资收益	8,448,501.76	221,481.37
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,141,201.97	520,811.29
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	380,039.79	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,717,019.72	355,243.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	117,521.74	57,818.71
减：二、费用	7,516,150.15	1,879,729.23
1. 管理人报酬	3,525,717.22	779,124.06
2. 托管费	528,857.55	116,868.58
3. 销售服务费	727,591.40	134,773.35
4. 交易费用	804,234.61	366,095.18
5. 利息支出	1,499,894.46	332,003.25
其中：卖出回购金融资产支出	1,499,894.46	332,003.25
6. 其他费用	429,854.91	150,864.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	9,814,990.18	2,013,569.72
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	9,814,990.18	2,013,569.72

注：本基金合同生效日为 2015 年 9 月 23 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2015 年 9 月 23 日至 2015 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：泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 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）	277,069,876.00	1,877,569.93	278,947,445.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	9,814,990.18	9,814,990.18
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）	123,875,075.09	8,334,540.70	132,209,615.79
其中：1. 基金申购款	286,351,499.82	12,729,151.15	299,080,650.97
2. 基金赎回款	-162,476,424.73	-4,394,610.45	-166,871,035.18
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）	400,944,951.09	20,027,100.81	420,972,051.90
项目	上年度可比期间 2015 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 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）	264,167,657.82	-	264,167,657.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	2,013,569.72	2,013,569.72
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）	12,902,218.18	-135,999.79	12,766,218.39
其中：1. 基金申购款	86,195,180.31	208,068.38	86,403,248.69
2. 基金赎回款	-73,292,962.13	-344,068.17	-73,637,030.30

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）	277,069,876.00	1,877,569.93	278,947,445.93

注：本基金合同生效日为 2015 年 9 月 23 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2015 年 9 月 23 日至 2015 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：

<u>金志刚</u>	<u>魏宇</u>	<u>魏宇</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]第 1808 号《关于准予泰康新回报灵活配置混合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《泰康新回报灵活配置混合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 264,165,508.96 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(2015)第 1114 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 264,167,657.82 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,148.86 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，基金托管人为北京银行股份有限公司(以下简称“北京银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康新回报灵活配置混合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股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货、国债期货、债券资产(包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、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、银行存款等固定收益类资产，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：股票资产占基金资产的 0%-95%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终

在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为： $30\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 65\% \times \text{中债新综合财富(总值)指数收益率} + 5\% \times \text{金融机构人民币活期存款利率(税后)}$ 。

本财务报表由基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司于 2017 年 3 月 27 号批准报出。

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 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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
北京银行股份有限公司（北京银行）	基金托管人、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、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；截至 2016 年 12 月 31 日投资账户名称的变更尚未完成。

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 2015 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 9 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,525,717.22	779,124.06
其中：支付销售机构的客户维护费	30,572.57	8,154.93

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 1%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 × 1% ÷ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 9 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	528,857.55	116,868.58

注：支付基金托管人北京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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C	合计
泰康资产管理有限责任公司	-	727,591.40	727,591.40
合计	-	727,591.40	727,591.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 9 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C	合计
泰康资产管理有限责任公司	-	134,773.35	134,773.35
合计	-	134,773.35	134,773.35

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 0.4% 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 × 0.4% ÷ 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
北京银行	-	-	-	-	139,000,000.00	8,378.08
上年度可比期间 2015 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 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
北京银行	-	-	-	-	-	-

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

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	222,914.66	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	222,914.66	-

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.1540%	-
-----------------------	---------	---

项目	上年度可比期间	
	2015 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2015 年 9 月 23 日) 持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注: 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额, 及自动升降级调增份额, 期间赎回/卖出总份额含转换出份额及自动升降级调减份额。

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

泰康新回报灵活配置混合 A				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	129,966,738.56	89.8082%	129,966,738.56	78.6463%

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; 截至 2016 年 12 月 31 日投资账户名称的变更尚未完成;

2. 本报告期末及上年度末, 除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金 C 级份额。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 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
北京银行	82,489.06	10,160.22	22,194.54	20,439.75

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，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 2015 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日, 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 2015 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 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（2016 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

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	网下新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	网下新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-

注：（1）基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

（2）截至本报告期末 2016 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债券。

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 2016 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 2016 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 64,999,702.50 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
150207	15 国开 07	2017 年 1 月 5 日	100.91	500,000	50,455,000.00
140225	14 国开 25	2017 年 1 月 5 日	100.77	150,000	15,115,500.00
合计				650,000	65,570,500.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

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 2016 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属于第一层次的余额为 48,633,151.47 元，属于第二层次的余额为 387,680,883.08 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 26,187,309.91 元，第二层次 282,936,599.60 元，无第三层次)。

(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 2016 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(2015 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。

§ 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	48,652,912.95	9.98
	其中：股票	48,652,912.95	9.98
2	固定收益投资	387,661,121.60	79.55
	其中：债券	387,661,121.60	79.55
	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	39,600,259.40	8.13
	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	5,694,558.83	1.17
7	其他各项资产	5,701,520.48	1.17
8	合计	487,310,373.26	100.00

注：本基金本报告期内未通过沪港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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,903,137.20	1.16

B	采矿业	13,223,500.00	3.14
C	制造业	27,825,775.75	6.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,700,500.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	48,652,912.95	11.56

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过沪港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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300138	晨光生物	698,605	12,735,569.15	3.03
2	002716	金贵银业	530,000	12,264,200.00	2.91
3	002155	湖南黄金	950,000	10,877,500.00	2.58
4	300498	温氏股份	77,760	2,738,707.20	0.65
5	601933	永辉超市	550,000	2,700,500.00	0.64
6	000726	鲁 泰 A	209,920	2,689,075.20	0.64

7	000975	银泰资源	150,000	2,346,000.00	0.56
8	000998	隆平高科	101,000	2,164,430.00	0.51
9	000869	张裕A	1,000	36,000.00	0.01
10	603806	福斯特	700	32,389.00	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <https://www.tkfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601118	海南橡胶	48,431,801.38	17.36
2	600547	山东黄金	28,618,799.81	10.26
3	002155	湖南黄金	25,995,070.90	9.32
4	300138	晨光生物	25,225,971.39	9.04
5	600497	驰宏锌锗	18,081,886.92	6.48
6	002237	恒邦股份	14,471,550.09	5.19
7	002716	金贵银业	14,291,769.11	5.12
8	600598	北大荒	13,308,847.00	4.77
9	002714	牧原股份	12,038,201.00	4.32
10	600893	中航动力	11,693,774.90	4.19
11	000423	东阿阿胶	9,513,694.38	3.41
12	002458	益生股份	8,737,798.83	3.13
13	600459	贵研铂业	8,679,966.88	3.11
14	000895	双汇发展	8,323,472.54	2.98
15	600111	北方稀土	7,935,937.61	2.84
16	300498	温氏股份	7,867,599.91	2.82
17	000878	云南铜业	7,679,278.11	2.75
18	000639	西王食品	7,599,715.73	2.72
19	002311	海大集团	7,525,297.68	2.70
20	600549	厦门钨业	6,129,566.07	2.20
21	000726	鲁泰A	5,940,369.81	2.13
22	000933	*ST 神火	5,780,701.30	2.07
23	000975	银泰资源	5,629,203.00	2.02

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

(2) “买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601118	海南橡胶	49,782,043.80	17.85
2	600547	山东黄金	32,998,480.21	11.83
3	600497	驰宏锌锗	18,537,223.23	6.65
4	002155	湖南黄金	16,499,256.47	5.91
5	002237	恒邦股份	15,813,812.40	5.67
6	300138	晨光生物	14,987,993.86	5.37
7	600598	北大荒	14,706,910.14	5.27
8	002714	牧原股份	11,911,791.88	4.27
9	600893	中航动力	11,414,337.25	4.09
10	000423	东阿阿胶	9,569,016.14	3.43
11	002311	海大集团	9,317,741.67	3.34
12	600459	贵研铂业	9,294,108.48	3.33
13	000895	双汇发展	9,216,527.85	3.30
14	002458	益生股份	9,102,493.31	3.26
15	000807	云铝股份	8,268,047.00	2.96
16	000878	云南铜业	7,909,624.27	2.84
17	600111	北方稀土	7,812,214.92	2.80
18	000639	西王食品	7,500,246.28	2.69
19	000726	鲁泰 A	7,235,942.00	2.59
20	300498	温氏股份	6,283,882.09	2.25
21	000933	*ST 神火	5,938,486.30	2.13
22	600549	厦门钨业	5,792,403.00	2.08

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

（2）“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	438,915,697.95
卖出股票收入（成交）总额	425,283,443.68

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，

卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

(2) “买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	963,192.60	0.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,686,000.00	19.17
	其中：政策性金融债	80,686,000.00	19.17
4	企业债券	10,228,000.00	2.43
5	企业短期融资券	79,942,000.00	18.99
6	中期票据	29,434,000.00	6.99
7	可转债（可交换债）	1,877,929.00	0.45
8	同业存单	184,530,000.00	43.83
9	其他	-	-
10	合计	387,661,121.60	92.09

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	150207	15 国开 07	500,000	50,455,000.00	11.99
2	111608321	16 中信 CD321	500,000	48,620,000.00	11.55
3	111611374	16 平安 CD374	500,000	48,190,000.00	11.45
4	140225	14 国开 25	300,000	30,231,000.00	7.18
5	111610369	16 兴业 CD369	300,000	29,247,000.00	6.95

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股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

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。

8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	184,008.38
2	应收证券清算款	19,240.49
3	应收股利	-
4	应收利息	5,493,173.41
5	应收申购款	5,098.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,701,520.48

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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 新 回 报 灵 活 配 置 混 合 A	1,241	116,612.37	130,189,653.22	89.96%	14,526,302.94	10.04%
泰 康 新 回 报 灵 活 配 置 混 合 C	7	36,604,142.13	256,228,994.93	100.00%	0.00	0.00%
合计	1,248	321,269.99	386,418,648.15	96.38%	14,526,302.94	3.62%

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	泰康新回 报灵活配 置混合 A	159,752.57	0.1104%
	泰康新回 报灵活配 置混合 C	0.00	0.0000%
	合计	159,752.57	0.0398%

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	泰康新回报灵活配置 混合 A	0
	泰康新回报灵活配置	0

本基金基金经理持有本开放式基金	混合 C	
	合计	0
	泰康新回报灵活配置混合 A	0
	泰康新回报灵活配置混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康新回报灵活配置混合 A	泰康新回报灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日）基金份额总额	161,667,057.82	102,500,600.00
本报告期期初基金份额总额	165,254,779.43	111,815,096.57
本报告期基金总申购份额	13,593,002.20	272,758,497.62
减:本报告期基金总赎回份额	34,131,825.47	128,344,599.26
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	144,715,956.16	256,228,994.93

注：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。

§ 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、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、本基金托管人、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 60,000.00 元；截至 2016 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

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。

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	
国泰君安证券股份有限公司	2	624,063,320.63	72.29%	199,905.35	72.15%	-
招商证券股份有限公司	2	239,247,925.81	27.71%	77,169.33	27.85%	-

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：①资金雄厚，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，并能为基金提供全面的信息服；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人，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。

（3）本报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

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
国泰君安证券股份有限公司	24,717,229.89	33.12%	363,900,000.00	39.64%	-	-
招商证券股份有限公司	49,903,060.24	66.88%	554,000,000.00	60.36%	-	-

泰康资产管理有限责任公司
2017 年 3 月 30 日