

泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金

[2016] 第一季度报告

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
报告送出日期:2016年4月22日

基金份额持有人的承诺书及董事和高级管理人员保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性负责。

基金管理人和基金托管人根据本基金合同的规定，于2016年4月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理承诺:本人声明已阅读并理解基金的管理运作费用、基金资产投资、基金合同等文件，了解基金产品的风险收益特征，同意基金的过往业绩并不代表其未来表现，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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期为2016年1月1日起至2016年3月31日止。

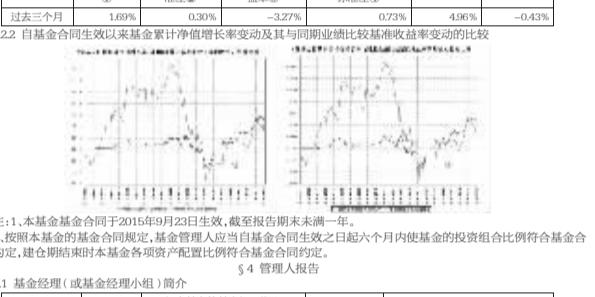
§ 2 基金产品概况

基金简称	泰康新回报灵活配置混合
交易代码	001798
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月10日
报告期末基金份额总额	227,777,777.0345份
投资目标	积极投资于股票资产，精选优质投资标的，在有效控制风险前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证综合债指数(全价)×65%+沪深300指数(全价)×30%+恒生综合指数(人民币计价)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。
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
基金类别	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	167,806,404.53份 59,970,629.97份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2016年1月1日—2016年3月31日)			
泰康新回报灵活配置混合C	泰康新回报灵活配置混合C			
1. 本期已实现收益	1,616,413.02			
2. 本期利润	2,863,009.30			
3. 期末可供分配利润余额(元)	0.00171			
4. 期末基金资产净值	171,866,046.81			
5. 期末基金份额净值	1.024			
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)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。				
3.21 本期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	泰康新回报灵活配置混合A			
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
过去三个月	1.69%	0.31%	-3.27%	0.73%
			4.96%	-0.42%

单位:人民币元



注:1.本基金合同于2015年1月23日生效，截至报告期末未满一年。

2.按照本基金的基金合同约定，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，建仓期结束后本基金各投资品种将符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介			
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限
蒋利娟	本基金基金经理	2015年9月23日	8
彭一博	本基金基金经理	2015年11月22日	7

注:本基金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部门中被聘用的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守信守纪律的情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公司内部监察稽核、风险控制情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现不公平交易及利益输送的情况。

4.4 报告期内基金交易行为的专项说明

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现不公平交易及利益输送的情况。

4.5 报告期内基金投资组合的重大关联交易情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现重大关联交易的情况。

4.6 报告期内基金估值政策和程序的说明

本报告期内本基金未出现因人情关系影响基金估值的情况。

4.7 报告期内基金投资组合的平均剩余期限

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现平均剩余期限超过180天的情况。

4.8 报告期内基金投资组合的偏离度情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现偏离度的情况。

4.9 报告期内基金投资组合的流动性情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现流动性的情况。

4.10 报告期内基金投资组合的杠杆倍数

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现杠杆倍数的情况。

4.11 报告期内基金投资组合的融资融券交易情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现融资融券交易的情况。

4.12 报告期内基金投资组合的衍生品投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现衍生品投资的情况。

4.13 报告期内基金投资组合的资产支持证券投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现资产支持证券投资的情况。

4.14 报告期内基金投资组合的国债期货投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现国债期货投资的情况。

4.15 报告期内基金投资组合的股票期权投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现股票期权投资的情况。

4.16 报告期内基金投资组合的股指期货投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现股指期货投资的情况。

4.17 报告期内基金投资组合的国债逆回购投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现国债逆回购投资的情况。

4.18 报告期内基金投资组合的存托凭证投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现存托凭证投资的情况。

4.19 报告期内基金投资组合的融资融券交易情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现融资融券交易的情况。

4.20 报告期内基金投资组合的衍生品投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现衍生品投资的情况。

4.21 报告期内基金投资组合的资产支持证券投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现资产支持证券投资的情况。

4.22 报告期内基金投资组合的国债期货投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现国债期货投资的情况。

4.23 报告期内基金投资组合的股票期权投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现股票期权投资的情况。

4.24 报告期内基金投资组合的股指期货投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现股指期货投资的情况。

4.25 报告期内基金投资组合的存托凭证投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现存托凭证投资的情况。

4.26 报告期内基金投资组合的融资融券交易情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现融资融券交易的情况。

4.27 报告期内基金投资组合的衍生品投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现衍生品投资的情况。

4.28 报告期内基金投资组合的资产支持证券投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现资产支持证券投资的情况。

4.29 报告期内基金投资组合的国债期货投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现国债期货投资的情况。

4.30 报告期内基金投资组合的股票期权投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现股票期权投资的情况。

4.31 报告期内基金投资组合的股指期货投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现股指期货投资的情况。

4.32 报告期内基金投资组合的存托凭证投资情况

本基金的公司治理结构完善，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金运作整体合法合规，没有出现存托凭证投资的情况。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2016年1月1日—2016年3月31日)	
泰康新回报灵活配置混合	泰康新回报灵活配置混合	
1. 本期已实现收益	1,730,185.03	
2. 本期利润	1,730,185.03	
3. 期末可供分配利润	2,213,165.3110份	
4. 期末基金资产净值	360,847,584.32份	
5. 期末基金份额净值	1.024份	
6. 期末基金份额净值增长率	1.024%	
7. 期末基金份额净值增长率标准差	0.0006%	

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.22 自基金合同生效以来本基金累计净值收益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

泰康新回报灵活配置混合B

