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

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	qichao1@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

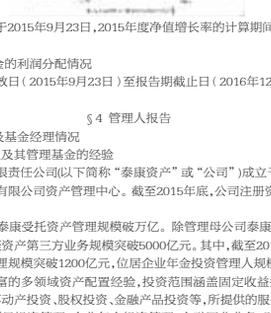
泰康新回报灵活配置混合A

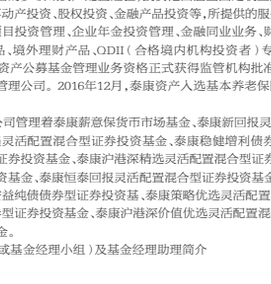
项目	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.00%	0.11%	-0.43%	0.26%	0.43%	-0.15%
过去六个月	1.74%	0.11%	1.70%	0.25%	0.04%	-0.14%
过去一年	4.57%	0.19%	-1.87%	0.43%	6.44%	-0.24%
自基金合同生效起至今	5.30%	0.18%	3.62%	0.44%	1.68%	-0.26%

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





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

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、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。2006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遵规守信情况的说明

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运作过程中得到公平对待,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,其享交易资源,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国债上行了20bp,10Y国开上行了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,部分行业和个股表现活跃。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

项目	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

姓名	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:

金志刚 魏宇 魏宇

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%×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)。

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