

泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金

2017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:2017年4月21日
基金合同生效日:2017年4月19日

基金管理人和基金托管人对本基金所载资料不承担任何责任,对其内容的真实性、准确性和完整性不承担个别及连带责任。
基金托管人北京银行股份有限公司根据基金合同约定,于2017年4月19日复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等信息,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期为2017年1月1日至2017年3月31日止。

5.2 基金净值表现

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

净值增长率: 0.01% (过去三个月)

业绩比较基准: 0.01% (过去三个月)

净值增长率与业绩比较基准的差额: 0.00% (过去三个月)

净值增长率与业绩比较基准的差额标准差: 0.00% (过去三个月)

5.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.1 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.2 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.3 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.4 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.5 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.6 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.7 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.8 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.9 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.10 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期已实现收益 -264,624.77

本期利润 -226,311.43

加权平均基金份额本期利润 -0.0303

期末基金资产净值 90,168,694.20

期末基金份额净值 1.0012

报告期期末基金资产净值 90,168,694.20

报告期期末基金份额净值 1.0012

注:1.基金的每万份基金单位预期收益和过去一个月净值涨跌幅数据截止于2017年3月31日。
2.基金的每万份基金单位净值是指基金资产净值除以基金总份额,是衡量基金投资运作情况的重要指标。
3.基金管理人应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,建仓期间除特殊情况外,本基金的每万份基金单位净值可能与同类基金的净值产生差异。

4.11 主要财务指标

报告期:2017年1月1日-2017年3月31日

泰康回报灵活配置混合型证券投资基金

本期