

## 泰康沪港深精选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:泰康资产有限公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司  
报告送出日期:2017年4月21日

基金管理人的董事局及董事会保证本报告所载资料不含虚假记载、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。

基金托管人对基金管理人履行基金合同的情况进行监督,于2017年4月19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。

基金管理人承诺就基金信息进行披露,确保向基金投资人提供的信息真实、准确、完整。

基金的过往业绩并不代表未来表现,投资有风险,投资人应当谨慎投资。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期为2017年1月1日起至2017年3月31日止。

5.1 基金产品概况

基金名称:泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

基金简称:泰康沪港深精选混合

基金代码:002533

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2016年4月6日

报告期基金资产净值:1,027,094,431.420

投资目标

本基金主要投资于中国内地股票市场和法律法规允许机构投资者买卖的特定范围内的港股投资,精选沪港深股票市场中的优质公司投资,力争获取超越标的指数的平均回报,实现基金资产的长期增值。

大类资产配置:本基金将综合考虑宏观经济运行、宏观政策、投资环境、行业配置、估值水平、个股选择、风险收益比等因素,通过定期评估和不定期评估,对资产配置比例进行动态调整。

投资策略

本基金将通过深入研究和精选,精选沪港深股票市场中的优质公司投资,力争获取超越标的指数的平均回报,实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准:沪深300指数\*60%+恒生指数\*30%+中证香港指数\*10%

基金管理人

泰康资产管理有限公司

基金托管人

中国银行股份有限公司

5.2 报告期期末基金资产净值

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)

1.本期已实现收益:15,835,233.09

2.本期利润:73,573,095.89

3.期末可供分配利润:1,042,727,476.47

4.期末可供分配基金份额净值:1.042

5.期末基金资产净值:1,042,727,476.47

注:(1)本期利润为扣除本期发生的管理人报酬后的剩余部分,即为可供分配的利润,本利润期为本期已实现收益加上本期的未实现收益。

(2)本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金所产生的费用,计费用后实际收益水平要低于所列数字。

5.3 基金净值表现

净值增长率:1.042%

净值增长率标准差:0.046%

业绩比较基准收益率:1.03%

业绩比较基准收益率的标准差:0.024%

注:对报告期(A)和报告期(B)期间的基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

5.4 报告期利润分配情况

单位:人民币元

报告期利润:1,027,094,431.420

利润总额:1,027,094,431.420

应付中国证监会规定的基金信息披露费:0.000

应付信息披露费:0.000

其他:0.000

5.5 期末基金资产组合情况

单位:人民币元

股票:951,583,742.5

债券:205,200,400.00

货币市场基金:17,205.00

银行存款和结算备付金:205,000.00

其他:1,167,360.43

注:本基金的资产配置比例符合基金合同的约定。

5.6 基金管理人报告

5.6.1 基金管理人报告期内本基金运作符合基金合同约定的运作操作规程,没有损害基金份额持有人利益的行为。

本基金报告期内不存在损害基金份额持有人利益的行为,基金管理人严格遵守法律法规及基金合同的规定,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

5.6.2 公平交易专项说明

本基金报告期内不存在不公平交易行为。

5.6.3 交易价格公平性说明

本基金报告期内不存在不公平交易行为。

5.6.4 报告期内本基金投资的证券的估值政策说明

本基金报告期内不存在不公平交易行为。

5.6.5 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内不存在股指期货交易行为。

5.6.6 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内不存在国债期货交易行为。

5.6.7 报告期内本基金投资的资产支持证券情况说明

本基金报告期内不存在资产支持证券投资行为。

5.6.8 报告期内本基金投资的黄金期货交易情况说明

本基金报告期内不存在黄金期货交易行为。

5.6.9 报告期内本基金投资的外汇交易情况说明

本基金报告期内不存在外汇交易行为。

5.6.10 报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金报告期内不存在权证交易行为。

5.6.11 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内不存在股指期货交易行为。

5.6.12 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内不存在国债期货交易行为。

5.6.13 报告期内本基金投资的资产支持证券情况说明

本基金报告期内不存在资产支持证券投资行为。

5.6.14 报告期内本基金投资的黄金期货交易情况说明

本基金报告期内不存在黄金期货交易行为。

5.6.15 报告期内本基金投资的外汇交易情况说明

本基金报告期内不存在外汇交易行为。

5.6.16 报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金报告期内不存在权证交易行为。

5.6.17 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内不存在股指期货交易行为。

5.6.18 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内不存在国债期货交易行为。

5.6.19 报告期内本基金投资的资产支持证券情况说明

本基金报告期内不存在资产支持证券投资行为。

5.6.20 报告期内本基金投资的黄金期货交易情况说明

本基金报告期内不存在黄金期货交易行为。

5.6.21 报告期内本基金投资的外汇交易情况说明

本基金报告期内不存在外汇交易行为。

5.6.22 报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金报告期内不存在权证交易行为。

5.6.23 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内不存在股指期货交易行为。

5.6.24 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内不存在国债期货交易行为。

5.6.25 报告期内本基金投资的资产支持证券情况说明

本基金报告期内不存在资产支持证券投资行为。

5.6.26 报告期内本基金投资的黄金期货交易情况说明

本基金报告期内不存在黄金期货交易行为。

5.6.27 报告期内本基金投资的外汇交易情况说明

本基金报告期内不存在外汇交易行为。

5.6.28 报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金报告期内不存在权证交易行为。

5.6.29 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内不存在股指期货交易行为。

5.6.30 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内不存在国债期货交易行为。

5.6.31 报告期内本基金投资的资产支持证券情况说明

本基金报告期内不存在资产支持证券投资行为。

5.6.32 报告期内本基金投资的黄金期货交易情况说明

本基金报告期内不存在黄金期货交易行为。

5.6.33 报告期内本基金投资的外汇交易情况说明

本基金报告期内不存在外汇交易行为。

5.6.34 报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金报告期内不存在权证交易行为。

5.6.35 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内不存在股指期货交易行为。

5.6.36 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内不存在国债期货交易行为。

5.6.37 报告期内本基金投资的资产支持证券情况说明

本基金报告期内不存在资产支持证券投资行为。

5.6.38 报告期内本基金投资的黄金期货交易情况说明

本基金报告期内不存在黄金期货交易行为。

5.6.39 报告期内本基金投资的外汇交易情况说明

本基金报告期内不存在外汇交易行为。

5.6.40 报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金报告期内不存在权证交易行为。

5.6.41 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内不存在股指期货交易行为。

5.6.42 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内不存在国债期货交易行为。

5.6.43 报告期内本基金投资的资产支持证券情况说明

本基金报告期内不存在资产支持证券投资行为。

5.6.44 报告期内本基金投资的黄金期货交易情况说明

本基金报告期内不存在黄金期货交易行为。

5.6.45 报告期内本基金投资的外汇交易情况说明

本基金报告期内不存在外汇交易行为。

5.6.46 报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金报告期内不存在权证交易行为。

5.6.47 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内不存在股指期货交易行为。

5.6.48 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内不存在国债期货交易行为。

5.6.49 报告期内本基金投资的资产支持证券情况说明

本基金报告期内不存在资产支持证券投资行为。

5.6.50 报告期内本基金投资的黄金期货交易情况说明

本基金报告期内不存在黄金期货交易行为。

5.6.51 报告期内本基金投资的外汇交易情况说明

本基金报告期内不存在外汇交易行为。

5.6.52 报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金报告期内不存在权证交易行为。

5.6.53 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内不存在股指期货交易行为。

5.6.54 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内不存在国债期货交易行为。

5.6.55 报告期内本基金投资的资产支持证券情况说明

本基金报告期内不存在资产支持证券投资行为。

5.6.56 报告期内本基金投资的黄金期货交易情况说明

本基金报告期内不存在黄金期货交易行为。

5.6.57 报告期内本基金投资的外汇交易情况说明

本基金报告期内不存在外汇交易行为。

5.6.58 报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金报告期内不存在权证交易行为。

5.6.59 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内不存在股指期货交易行为。

5.6.60 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内不存在国债期货交易行为。

5.6.61 报告期内本基金投资的资产支持证券情况说明

本基金报告期内不存在资产支持证券投资行为。

5.6.62 报告期内本基金投资的黄金期货交易情况说明

本基金报告期内不存在黄金期货交易行为。

5.6.63 报告期内本基金投资的外汇交易情况说明

本基金报告期内不存在外汇交易行为。