

泰康恒泰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：交通银行股份有限公司
报告截止日期：2017年3月31日

§ 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。

基金托管人和交通银行股份有限公司根据本基金合同，于2017年4月10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。

基金管理人承诺诚实地运用基金财产，勤勉尽责地履行职责和使用基金财产，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。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

交易代码：002034

基金名称：泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金

基金合同期效日：2017-01-01至2017-12-31

报告期末基金资产总额：100,000,000.00元

投资目标：本基金通过合理的风险管理，在通过大类资产的优化配置和安全边际的识别让投资者，追求超越行业平均水平的回报。

基金运作方式：契约型开放式

基金经理：刘伟

投资策略：本基金在深入分析和综合评估的基础上，通过大类资产的优化配置和安全边际的识别让投资者，追求超越行业平均水平的回报。

业绩比较基准：中证综合债指数×70%+沪深300指数×20%+银行存款利率(税后)×10%

风险收益特征：本基金为混合型基金，风险收益特征为股票型基金与债券型基金的复合特征。

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

下阶段基金的基金代码：002034

报告期末分级基金的份额总额：496,940,122,024份

§ 3 主要财务指标

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日) 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)

泰康恒泰回报混合C 1,196,900 3,885,112.10

泰康恒泰回报混合A 26,645,458 7,377,287.90

加权平均基金份额本期利润 0.0197 0.0148

期末基金资产净值 826,174,086 503,867,737.98

期末基金份额净值 1.0165 1.0139

注：1.本基金基金合同于2016年7月13日生效，截至报告期末未满一年。
2.按本基金的基金合同规定，基金管理人应当在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均符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人简介

姓名 职务 在任日期 离任日期 说明

刘伟 基金经理 2016年7月13日 - 10 由于个人原因，刘伟先生于2016年7月13日辞职，由刘伟先生推荐的接任人为刘伟。

注11.证券从业的人员遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。刘伟先生的辞职和接任期间均向公司相关部门报告辞职和接任情况。

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

本报告期内，基金管理人严格按照法律法规、基金合同的规定，履行诚实信用、严格管理、谨慎运作的义务，通过各种合法的手段执行基金合同，使得基金的投资运作符合相关法律法规、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。

4.3 基金管理人建立并完善内部的风险控制、内部控制制度和风险控制流程，并在获得信息反馈、投资建议和实施投资决策方案等方面享有充分的自主权。

4.4 常规交易行为的专项说明

本基金管理人建立了正常的交易监控和报告制度，对异常交易进行定期、事前和事后的情况报告，报告期内，没有出现本基金管理人认为可能显著影响市场价格的异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金估值政策的说明

本基金管理人建立了公平的估值政策，通过定期和不定期的估值方法，对基金资产进行估值，从而确保基金的估值公允、合理。

4.6 报告期内基金的费用计提、使用情况及与基金合同一致的情况

本基金费用计提、使用情况及与基金合同一致。

4.7 报告期内基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内基金的费用计提、使用情况及与基金合同一致的情况

本基金未进行费用计提、使用情况及与基金合同一致。

4.9 报告期内基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

4.10 报告期内基金的费用计提、使用情况及与基金合同一致的情况

本基金未进行费用计提、使用情况及与基金合同一致。

4.11 证券投资的关联交易

本基金未进行证券投资的关联交易。

4.12 其他费用

本基金未进行其他费用的计提、使用情况及与基金合同一致。

4.13 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.14 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.15 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.16 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.17 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.18 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.19 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.20 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.21 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.22 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.23 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.24 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.25 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.26 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.27 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.28 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.29 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.30 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.31 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.32 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.33 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.34 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.35 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.36 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.37 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.38 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.39 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.40 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.41 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.42 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.43 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.44 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.45 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.46 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.47 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.48 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.49 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.50 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.51 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.52 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.53 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.54 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.55 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.56 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.57 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.58 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.59 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.60 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.61 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.62 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.63 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。

4.64 报告期内未进行的报告事项

本基金未进行报告事项。