

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金
2016 年年度报告摘要
2016 年 12 月 31 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月三十一日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人兴业银行股份有限公司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、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	太平灵活配置
基金主代码	000986
交易代码	000986
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015 年 2 月 10 日
基金管理人	太平基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,289,482,565.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过优化资产配置和灵活运用多种投资策略，寻找推动经济增长的内在动力，精选具有较高成长性和投资价值的金融工具，在充分控制投资风险的基础上，力争实现持续稳定的投资回报。
投资策略	<p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金采用自上而下的多因素分析方法进行宏观策略研究，对宏观经济方面重大问题、突发事件、重大政策进行及时研究与评估，对影响证券市场的相关因素（政策、资金、利率走向、行业比较、上市公司盈利增长预期、估值水平、市场心理等）进行综合考量，分析和预测证券市场走势和行业热点，预测权益类资产和固定收益类资产的风险收益特征，确定中长期的资产配置方案。在公司投资决策委员会的统一指导下进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、股指期货等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险并提高收益。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金采用灵活的股票投资策略，充分挖掘中国经济结构调整和产业升级</p>

	<p>级衍伸的投资机会，关注具有持续高成长性的行业和上市公司，以分享经济增长带来的投资回报。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>本基金债券投资策略主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略等。</p> <p>（四）股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货投资。本基金通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，对股指期货合约进行估值定价，并与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。</p> <p>（五）权证投资策略</p> <p>本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。</p> <p>本基金的权证投资，是在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，投资于合理内在价值的权证品种。</p>
业绩比较基准	1 年期银行定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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	太平基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈吟绮
	联系电话	021-38556782
	电子邮箱	disclosure@taipingfund.com.cn
客户服务电话	021-38874600	95561

传真	021-38556677	021-62535823
----	--------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室

§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 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,317,424.78	-3,755,873.67
本期利润	-1,730,000.40	-3,628,008.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0528	-0.2465
本期基金份额净值增长率	-16.05%	-21.50%
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	-0.3421	-0.2499
期末基金资产净值	1,508,928,593.89	12,725,172.98
期末基金份额净值	0.659	0.785

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（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上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。

3.2 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

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	-7.96%	0.81%	0.89%	0.01%	-8.85%	0.80%
过去六个月	-9.35%	0.86%	1.78%	0.01%	-11.13%	0.85%
过去一年	-16.05%	0.78%	3.57%	0.01%	-19.62%	0.77%
自基金合同生效起至今	-34.10%	1.46%	7.35%	0.01%	-41.45%	1.45%

注：本基金的业绩比较基准为：1 年期银行定期存款利率（税后）+2%。

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

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 2 月 10 日至 2016 年 12 月 31 日)

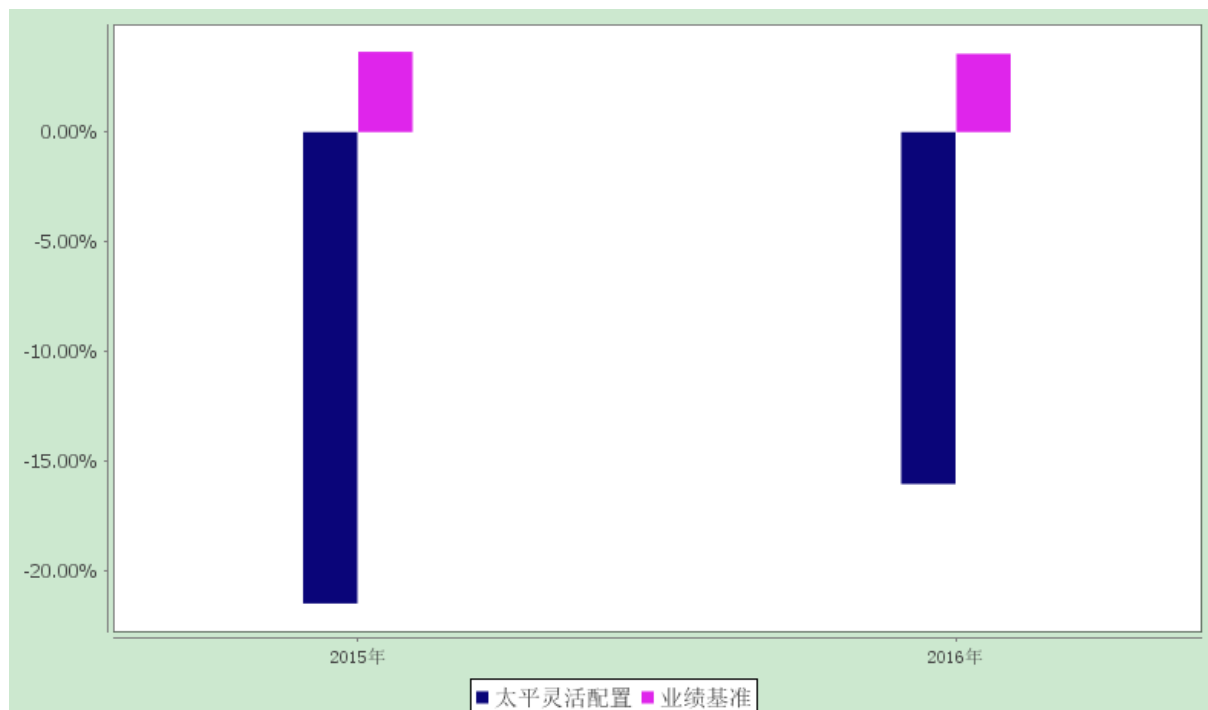


注：本基金基金合同于 2015 年 2 月 10 日生效；按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，本基金已完成建仓，本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

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

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 2 月 10 日，至本报告期末未满 5 年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§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

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立。目前公司注册资本为人民币 2.27 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 70.04%，中原证券股份有限公司的出资占注册资本的 14.98%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 14.98%。

目前公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等，在投资管理、策

略设计、产品设计、客户服务等方面配置了专业团队及集中了优势资源，力求为客户创造长期持续稳健的回报。截至本报告期末，公司共管理 2 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
翁锡赞	本基金的基金 经理、固定收 益部总监	2016-03- 08	-	12	复旦大学金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2004 年 1 月起曾在兴业基金管理有限公司（现兴业全球基金管理有限公司）任首席交易员和债券研究员，万家基金管理有限公司任基金经理助理，国泰基金管理有限公司任国泰货币市场证券投资基金基金经理（任职期间：2008 年 8 月 23 日至 2011 年 6 月 15 日）、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金经理（任职期间：2010 年 6 月 10 日至 2011 年 6 月 15 日）、社保 409、709 组合投资经理，东吴证券股份有限公司任债券投资部副总经理，国泰君安（香港）有限公司任国泰君安巨龙中国固定收益基金（RQFII）基金经理（任职期间：2012 年 3 月 9 日至 2013 年 11 月 22 日）、高级副总裁，在本公司任中原英石货币市场基金基金经理（任职期间：2014 年 9 月 11 日至 2015 年 10 月 21 日）等职。中国国籍。
独孤南薰	本基金的基金 经理	2016-04- 07	-	13	美国西北大学经济学学士，具有证券投资基金从业资格。2003 年 10 月起曾在台湾凯基证券上海研究部、工银瑞信基金管理有限公司、汇丰晋信基金管理有限公司、安信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司担任研究员、高级研究员等职。

					2013 年 4 月加入本公司，先后担任研究员、本基金的基金经理助理、投资经理。中国国籍。
赵梓峰	本基金的基金经理、兼任投资副总监、研究总监	2015-02-10	2016-03-17	22	上海交通大学工学学士，具有证券投资基金从业资格。1993 年 8 月起曾在渣打证券公司上海代表处、法国兴业证券公司上海代表处、元富证券公司上海代表处、凯基（北京）管理咨询公司任研究员、研究主管等职，在上投摩根基金管理有限公司任研究总监、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理（任职期间：2007 年 3 月 20 日至 2011 年 5 月 25 日），在中原英石基金管理有限公司任中原英石货币市场基金基金经理（任职时间：2014 年 9 月 11 日至 2015 年 10 月 21 日）等职。中国国籍。

注：1、基金经理的任职日期和离职离任日期一般情况下指为公司对外公告之日；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、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。

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有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，未发生违法违规或未履行基金合同的情形。

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

在内控制度方面，公司根据相关法律法规制订了规范的投资管理制度和公平交易管理制度，以确保公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，研究团队为公司所有投资组合提供平等、公平的研究支持，所有投资组合共享公司统一的投资研究平台；严格实行各类资产管理业务之间的业务隔离和人员隔离制度，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，各投资组合的持仓及交易信息等均有效隔离。在交易执行方面，实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，保证交易在各投资组合间的公正实施。在监控和稽核方面，交易部门在交易执行过程中对公平交易实施一线监控与报告，稽核风控部对投资交

易行为进行持续监督和评估，定期进行公平交易的分析工作，每季度和每年度对不同投资组合的收益率差异以及同向交易和反向交易情况进行分析，加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本基金管理人管理的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的 5% 的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

本基金在年初的时候，经历了熔断的以后，为避免更大的风险，降低了仓位，并且保持到了二季度初期。随着市场的转暖，熔断负面影响的逐步消除，本基金也随之逐步加仓，配置了行业有复苏迹象并且估值较低的大消费板块，取得了较好的收益。三季度以后，随着供给侧改革的加深，周期行业纷纷出现了较大的涨幅，本基金进行了一系列的调仓，企图适应市场风格的转变。但是由于周期的风口，切换较快，给本基金实际操作带来了一定的困难，因此收益不是太理想。着眼未来考虑，本基金进行了又一次调仓，逐步回归到行业出现拐点，且估值相对便宜，业绩有超预期可能的板块及个股上。虽然当时收益不大，但是我们认为 2017 年打下了良好的基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-16.05%，同期业绩比较基准收益率为 3.57%。

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，我们倾向于上半年的经济环境或许会好于下半年，市场的机会可能在上半年会

更多一点。受益于 2016 年的房地产复苏，以及其对于相关行业、整体经济的带动，2017 年上半年整体经济依然会受到其的正面影响，使得经济整体处在一个较为良性的发展趋势之中。房地产以及相关产业，可能会有较好的表现。而下半年则由于惯性的减弱，在新的增长点出现之前，我们对于经济可能会采取较为谨慎的看法。从市场角度看，可能全年都不乏亮点。涨价预期下，大消费板块或许会有较好的表现，白酒、家电、家居或许存在持续性的机会。而国企改革的深入，也会为市场带来较多的投资标的。我们将会采取，至少在上半年，积极的投资策略，寻找有估值安全边际的成长股、受益于国企改革或供给侧改革的公司、基本面改善的行业等方面的投资机会，并适当的控制仓位，力争给投资者满意的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金估值定价与评估制度》和《太平基金管理有限公司基金会计业务管理制度》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员由营运总监负责，成员包括投资组合经理、行业研究员、风控人员、金融工程研究员及基金会计等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

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约定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定，本基金为发起式基金，自本基金合同生效之日起至报告期末本基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条。

§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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师薛竞、都晓燕签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过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：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	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	995,391,551.44	7,662,305.66
结算备付金	31,507.51	79,304.89
存出保证金	13,356.15	22,445.95
交易性金融资产	8,666,191.00	5,013,206.40
其中：股票投资	8,116,906.00	4,254,541.00
基金投资	-	-
债券投资	549,285.00	758,665.40

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	504,901,677.35	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	263,027.65	16,554.66
应收股利	-	-
应收申购款	-	15,976.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,509,267,311.10	12,809,793.59
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	4,170.06	1,624.72
应付管理人报酬	134,410.62	15,551.39
应付托管费	22,401.75	2,591.89
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	17,726.94	14,851.19
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,007.84	50,001.42

负债合计	338,717.21	84,620.61
所有者权益：	-	-
实收基金	2,289,482,565.25	16,209,168.25
未分配利润	-780,553,971.36	-3,483,995.27
所有者权益合计	1,508,928,593.89	12,725,172.98
负债和所有者权益总计	1,509,267,311.10	12,809,793.59

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.659 元，基金份额总额 2,289,482,565.25 份。

2. 比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 2 月 10 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	上年度可比期间 2015 年 2 月 10 日（基金合 同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-1,129,747.28	-3,074,291.70
1.利息收入	339,113.91	113,236.56
其中：存款利息收入	212,799.73	97,156.06
债券利息收入	15,004.41	16,080.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	111,309.77	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,065,097.30	-3,330,621.84
其中：股票投资收益	-1,117,833.99	-3,375,156.88
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,876.50	-1,348.00

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	55,613.19	45,883.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-412,575.62	127,865.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	8,811.73	15,228.54
减：二、费用	600,253.12	553,716.93
1. 管理人报酬	275,441.33	188,765.07
2. 托管费	45,906.92	31,460.83
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	92,004.87	182,136.03
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	186,900.00	151,355.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,730,000.40	-3,628,008.63
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,730,000.40	-3,628,008.63

注：比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 2 月 10 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

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)	16,209,168.25	-3,483,995.27	12,725,172.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,730,000.40	-1,730,000.40
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)	2,273,273,397.00	-775,339,975.69	1,497,933,421.31
其中：1.基金申购款	2,277,779,974.91	-776,619,765.59	1,501,160,209.32
2.基金赎回款	-4,506,577.91	1,279,789.90	-3,226,788.01
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)	2,289,482,565.25	-780,553,971.36	1,508,928,593.89
项目	上年度可比期间		
	2015 年 2 月 10 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)	13,557,227.44	-	13,557,227.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,628,008.63	-3,628,008.63
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)	2,651,940.81	144,013.36	2,795,954.17
其中：1.基金申购款	4,854,010.22	332,953.96	5,186,964.18

2.基金赎回款	-2,202,069.41	-188,940.60	-2,391,010.01
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）	16,209,168.25	-3,483,995.27	12,725,172.98

注：比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 2 月 10 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：宋小龙，主管会计工作负责人：宋卫华，会计机构负责人：田瀚

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金(原名为“中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金”，以下简称“太平灵活配置混合基金”、“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[2014]1392 号文件核准，由太平基金管理有限公司负责公开募集并担任基金管理人和注册登记机构，兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)担任基金托管人。基金管理人太平基金管理有限公司于 2015 年 1 月 23 日至 2015 年 2 月 5 日对符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者公开发售。募集期结束经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具普华永道中天验字(2015)第 115 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本基金基金合同于 2015 年 2 月 10 日正式生效。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限不定期。本基金首次向社会公开发售且扣除认购费用后的募集资金金额共计人民币 13,555,569.64 元，上述募集资金根据基金份额初始面值人民币 1.00 折合为 13,555,569.64 份基金份额。截至 2015 年 2 月 9 日止，本基金经注册登记系统确认的募集期间有效认购资金按实际适用年利率计算产生的利息折份额部分共计人民币 1,657.80 元，按基金份额初始面值人民币 1.00 元折合为 1,657.80 份基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据本基金管理人于 2016 年 9 月 29 日发布的《太平基金管理有限公司关于旗下中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金更名的公告》，中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金自 2016 年 9 月 29 日起更名为太平灵活配置混合型发起式证券投资基金。

本基金为发起式基金。基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员认购金额不低于 1,000 万元，认购的基金份额持有期限不低于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象为良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、可转换债券、银行存款和债券等资产，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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，固定收益类资产投资占基金资产的比例为 5%-100%，扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后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%。本基金的业绩比较基准为：1 年期银行定期存款利率(税后)+2%。

本财务报表由本基金的基金管理人太平基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

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》、《太平灵活配置混合型发起式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

本基金本报告期未发生重大会计差错的内容和更正金额。

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
太平基金管理有限公司（“太平基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
太平资产管理有限公司（“太平资产”）	基金管理人的股东
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
中原证券股份有限公司（“中原证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
安石投资管理有限公司（“安石投资”）	基金管理人的股东

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.本报告期内，中原证券与安石投资分别向太平资管转让 34%和 32%的太平基金的股权，且太平资管向太平基金增资 2,700 万元。两次股权变更于 2016 年 8 月 22 日正式完成工商注册变更，变更后太平资管、中原证券和安石投资在太平基金的股权占比分别为 70.04%、14.98%和 14.98%，太平基金的公司名称由“中原英石基金管理有限公司”变更为“太平基金管理有限公司”。

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

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年2月10日（基金合同生效日） 至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中原证券股份有限公司	15,881,665.94	23.51%	24,429,181.98	18.32%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中原证券股份有限公司	11,614.32	21.16%	6,539.17	40.74%
关联方名称	上年度可比期间 2015年2月10日（基金合同生效日）至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中原证券股份有限公司	17,664.09	16.83%	6,436.91	43.34%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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2月10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	275,441.33	188,765.07
其中：支付销售机构的客户维护费	5,657.51	3,564.12

注：注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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 X 1.50% / 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2月10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	45,906.92	31,460.83

注：注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 X 0.25% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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2月10日（基金合同生 效日）至2015年12月31日
基金合同生效日（2015年2月 10日）持有的基金份额	-	10,001,375.14
期初持有的基金份额	10,001,375.14	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,001,375.14	10,001,375.14
期末持有的基金份额占基金总 份额比例	0.44%	61.70%

注：本基金管理人按照本基金基金合同、招募说明书的约定费率进行认购、申购和赎回，不享
第22页共38页

有比其他投资人更优惠的费率。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年2月10日（基金合同生效日） 至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	995,391,551.44	212,141.22	7,662,305.66	70,032.02

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2016年1月1日至2016年12月31日止期间获得的备付金利息收入为人民币479.05元，2016年12月31日结算备付金余额为人民币31,507.51元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
30058	天铁	2016-	2017-	新股	14.11	14.11	500.00	7,055.	7,055.	新股

7	股份	12-28	01-05	认购				00	00	未上市
---	----	-------	-------	----	--	--	--	----	----	-----

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002239	奥特佳	2016-10-18	重大事项	15.69	2017-02-07	14.12	17,000.00	269,362.58	266,730.00	-
300213	佳讯飞鸿	2016-11-04	重大事项	28.00	2017-02-17	25.48	10,000.00	274,750.00	280,000.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 8,116,906.00 元，属于第二层次的余额为 549,285.00 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 4,254,541.00 元，第二层次 758,665.40 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,116,906.00	0.54
	其中：股票	8,116,906.00	0.54
2	固定收益投资	549,285.00	0.04
	其中：债券	549,285.00	0.04
	资产支持证券	-	-

3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	504,901,677.35	33.45
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	995,423,058.95	65.95
7	其他各项资产	276,383.80	0.02
8	合计	1,509,267,311.10	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,863,746.00	0.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	207,480.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	238,320.00	0.02
J	金融业	513,920.00	0.03
K	房地产业	293,440.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,116,906.00	0.54

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600500	中化国际	55,000	641,300.00	0.04
2	000568	泸州老窖	15,000	495,000.00	0.03
3	000596	古井贡酒	8,442	384,111.00	0.03
4	600519	贵州茅台	1,100	367,565.00	0.02
5	600318	新力金融	10,000	322,000.00	0.02
6	600596	新安股份	30,000	307,200.00	0.02
7	000656	金科股份	56,000	293,440.00	0.02
8	600518	康美药业	16,000	285,600.00	0.02
9	300136	信维通信	10,000	285,000.00	0.02
10	300213	佳讯飞鸿	10,000	280,000.00	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002508	老板电器	1,151,271.00	9.05
2	600809	山西汾酒	1,053,496.00	8.28
3	300033	同花顺	961,022.06	7.55
4	000766	通化金马	847,535.00	6.66
5	000596	古井贡酒	661,676.50	5.20
6	600519	贵州茅台	643,435.00	5.06
7	000858	五粮液	582,129.00	4.57
8	002043	兔宝宝	580,348.00	4.56
9	002643	万润股份	578,065.37	4.54

10	000983	西山煤电	571,220.00	4.49
11	000656	金科股份	570,080.00	4.48
12	000937	冀中能源	564,333.00	4.43
13	600518	康美药业	563,736.00	4.43
14	600500	中化国际	562,270.00	4.42
15	600606	绿地控股	560,790.00	4.41
16	601225	陕西煤业	555,819.00	4.37
17	600373	中文传媒	554,541.04	4.36
18	300327	中颖电子	553,634.70	4.35
19	300258	精锻科技	552,866.00	4.34
20	000712	锦龙股份	548,309.00	4.31
21	002032	苏泊尔	548,256.00	4.31
22	300061	康耐特	546,085.00	4.29
23	601555	东吴证券	543,058.00	4.27
24	601628	中国人寿	536,351.00	4.21
25	002239	奥特佳	533,002.91	4.19
26	002466	天齐锂业	531,410.00	4.18
27	002303	美盈森	521,773.30	4.10
28	000523	广州浪奇	502,711.00	3.95
29	000568	泸州老窖	455,889.00	3.58
30	300059	东方财富	369,896.00	2.91
31	300016	北陆药业	362,821.00	2.85
32	002343	慈文传媒	362,413.00	2.85
33	600161	天坛生物	360,348.97	2.83
34	002510	天汽模	359,260.00	2.82
35	002642	荣之联	356,860.00	2.80
36	601009	南京银行	352,110.00	2.77
37	600596	新安股份	327,150.00	2.57
38	600318	新力金融	321,480.00	2.53
39	002624	完美世界	298,501.00	2.35
40	600604	市北高新	297,050.00	2.33
41	600199	金种子酒	294,369.00	2.31
42	002271	东方雨虹	290,817.10	2.29
43	000418	小天鹅 A	290,106.00	2.28
44	002719	麦趣尔	288,982.00	2.27
45	601799	星宇股份	287,804.00	2.26
46	600999	招商证券	287,140.00	2.26
47	002402	和而泰	286,497.00	2.25
48	300316	晶盛机电	286,360.00	2.25
49	603818	曲美家居	285,433.00	2.24
50	600498	烽火通信	285,244.00	2.24
51	300017	网宿科技	284,698.00	2.24
52	600826	兰生股份	282,220.00	2.22
53	002600	江粉磁材	281,740.00	2.21

54	002081	金螳螂	281,120.00	2.21
55	002089	新海宜	280,806.00	2.21
56	000959	首钢股份	280,500.00	2.20
57	002304	洋河股份	280,132.00	2.20
58	300295	三六五网	279,406.00	2.20
59	600487	亨通光电	279,110.00	2.19
60	600643	爱建集团	278,960.00	2.19
61	300158	振东制药	278,610.00	2.19
62	300104	乐视网	277,967.00	2.18
63	601688	华泰证券	277,707.00	2.18
64	002617	露笑科技	275,995.00	2.17
65	600166	福田汽车	275,800.00	2.17
66	600837	海通证券	275,401.00	2.16
67	300213	佳讯飞鸿	274,750.00	2.16
68	002588	史丹利	272,988.00	2.15
69	600216	浙江医药	272,444.00	2.14
70	002444	巨星科技	271,749.00	2.14
71	300136	信维通信	270,400.00	2.12
72	000823	超声电子	270,269.00	2.12
73	300232	洲明科技	268,874.00	2.11
74	600702	沱牌舍得	266,473.00	2.09
75	600340	华夏幸福	264,820.00	2.08
76	300043	星辉娱乐	263,250.00	2.07
77	000776	广发证券	263,015.00	2.07
78	002001	新和成	262,926.00	2.07
79	600898	三联商社	259,572.00	2.04
80	600030	中信证券	259,500.00	2.04
81	600188	兖州煤业	257,331.00	2.02
82	600048	保利地产	256,800.00	2.02
83	002758	华通医药	255,053.00	2.00

注：买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002508	老板电器	1,204,515.00	9.47
2	600809	山西汾酒	904,671.00	7.11
3	000766	通化金马	879,963.00	6.92
4	300033	同花顺	842,100.00	6.62

5	600807	天业股份	768,342.00	6.04
6	000858	五 粮 液	608,040.00	4.78
7	000712	锦龙股份	601,330.00	4.73
8	000937	冀中能源	597,050.00	4.69
9	000823	超声电子	581,966.00	4.57
10	601555	东吴证券	573,350.00	4.51
11	002032	苏 泊 尔	572,870.00	4.50
12	300258	精锻科技	567,419.00	4.46
13	002643	万润股份	564,277.00	4.43
14	000983	西山煤电	563,461.90	4.43
15	002171	楚江新材	550,940.00	4.33
16	002466	天齐锂业	543,329.00	4.27
17	600606	绿地控股	543,020.00	4.27
18	601225	陕西煤业	523,501.00	4.11
19	002303	美盈森	519,359.00	4.08
20	600373	中文传媒	504,100.00	3.96
21	300327	中颖电子	502,011.00	3.95
22	002335	科华恒盛	465,431.40	3.66
23	000523	广州浪奇	461,680.00	3.63
24	002719	麦趣尔	389,635.00	3.06
25	000656	金科股份	341,900.00	2.69
26	600161	天坛生物	338,469.07	2.66
27	002271	东方雨虹	333,827.50	2.62
28	002239	奥特佳	319,970.00	2.51
29	600487	亨通光电	314,314.00	2.47
30	601009	南京银行	313,900.00	2.47
31	600519	贵州茅台	309,153.00	2.43
32	002402	和而泰	307,409.00	2.42
33	002343	慈文传媒	305,721.00	2.40
34	600999	招商证券	303,720.00	2.39
35	002043	兔 宝 宝	301,664.00	2.37
36	600898	三联商社	294,760.00	2.32
37	000596	古井贡酒	292,477.41	2.30
38	600199	金种子酒	290,752.00	2.28
39	600518	康美药业	288,180.00	2.26
40	002081	金 螳 螂	287,300.00	2.26
41	600510	黑牡丹	287,038.46	2.26
42	600826	兰生股份	284,758.00	2.24
43	000418	小天鹅 A	284,665.00	2.24
44	600837	海通证券	283,220.00	2.23
45	300104	乐视网	278,740.00	2.19
46	300017	网宿科技	278,231.00	2.19
47	601799	星宇股份	277,432.00	2.18
48	002180	艾派克	277,228.00	2.18

49	002304	洋河股份	276,675.00	2.17
50	002510	天汽模	275,352.00	2.16
51	300016	北陆药业	274,882.00	2.16
52	000939	凯迪生态	273,700.00	2.15
53	300059	东方财富	273,050.00	2.15
54	600216	浙江医药	270,476.00	2.13
55	300061	康耐特	266,654.00	2.10
56	300207	欣旺达	266,113.08	2.09
57	002089	新海宜	265,823.00	2.09
58	600604	市北高新	263,892.00	2.07
59	600340	华夏幸福	263,458.00	2.07
60	300295	三六五网	262,120.00	2.06
61	002642	荣之联	258,389.42	2.03
62	600188	兖州煤业	255,507.00	2.01
63	000959	首钢股份	255,500.00	2.01
64	002588	史丹利	255,204.00	2.01
65	002001	新和成	254,810.00	2.00

注：卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	36,504,862.95
卖出股票的收入（成交）总额	31,111,812.24

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	549,285.00	0.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	549,285.00	0.04

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019539	16 国债 11	5,500	549,285.00	0.04

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责处罚的情况。

8.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票中没有出现超出基金合同规定备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,356.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	263,027.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	276,383.80

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300213	佳讯飞鸿	280,000.00	0.02	停牌或网下申购锁定期

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
277	8,265,280.02	2,286,175,881.97	99.86%	3,306,683.28	0.14%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	12,158.33	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额总 数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,375.1 4	0.44%	10,001,375.1 4	0.44%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,375.1 4	0.44%	10,001,375.1 4	0.44%	-

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年2月10日)基金份额总额	13,557,227.44
本报告期期初基金份额总额	16,209,168.25
本报告期基金总申购份额	2,277,779,974.91
减：本报告期基金总赎回份额	4,506,577.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,289,482,565.25

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动情况

(1) 经中原英石基金管理有限公司第一届董事会 2015 年第二十一次会议审议通过，公司总经林伟萌先生于 2016 年 1 月 30 日任期届满后不再续聘。上述事项已按规定向相关监管机构报告，并于 2016 年 2 月 1 日发布了《中原英石基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

(2) 经中原英石基金管理有限公司第一届董事会 2016 年第一次会议审议通过，黄竹平先生因个人原因于 2016 年 1 月 30 日任期届满后不再担任公司副总经理职务。上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会上海监管局报告，并于 2016 年 2 月 1 日发布了《中原英石基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

(3) 经太平基金管理有限公司第二届董事会 2016 年第十三次会议审议通过，公司聘请汤海涛先生为太平基金管理有限公司董事长，周小全先生不再担任公司董事长职务。上述事项已按相关规定进行备案，并于 2016 年 8 月 23 日发布了《太平基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

(5) 经太平基金管理有限公司第二届董事会 2016 年第十三次会议审议通过，于 2016 年 8 月 22 日起公司总经理变更为宋小龙先生。上述事项已按相关规定进行备案，并于 2016 年 8 月 23 日

发布了《太平基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

(6) 经太平基金管理有限公司第二届董事会 2016 年第十三次会议审议通过，于 2016 年 8 月 22 日起聘请金芳女士为公司副总经理。上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会上海监管局备案，并于 2016 年 8 月 23 日发布了《太平基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

(7) 经太平基金管理有限公司 2016 年第十次股东会审议通过，选举汤海涛先生、李冠莹先生、邓先虎先生、宋小龙先生、宋卫华先生担任公司董事；选举胡志浩先生、范祚军先生担任公司独立董事。菅明军先生、周小全先生、鲁智礼先生、徐军先生不担任公司董事；郑锦桥先生、Robert Hector John SPENCE 先生不担任公司独立董事。上述事项已按有关规定进行备案，并于 2016 年 8 月 23 日发布了《太平基金管理有限公司关于公司董事变更的公告》。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日（2015 年 2 月 10 日）起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。本报告期内应支付的审计费用为人民币陆万贰仟陆佰壹拾陆元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	16,741,439.11	24.78%	15,591.27	28.40%	-

海通证券	1	16,602,497.28	24.57%	12,141.43	22.12%	-
中原证券	2	15,881,665.94	23.51%	11,614.32	21.15%	-
兴业证券	1	10,716,308.43	15.86%	9,980.03	18.18%	-
国海证券	1	7,618,609.43	11.28%	5,571.31	10.15%	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

- (1) 市场形象及财务状况良好。
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (3) 内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (4) 研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

根据上述标准进行考察后，由基金管理人的投资决策委员会确定租用券商的交易单元，并由基金管理人或被选择的券商签订协议。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本报告期为基金租用证券公司交易单元无变化。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
招商证券	550,220.00	100.00%	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2016 年 8 月 23 日发布公告，经基金管理人股东会决议通过，并经中国证监会批复核准（证监许可【2016】1681 号），本公司股东中原证券股份有限公司与安石投资管理有限公司分别向太平资产管理有限公司转让部分股权，同时完成注册资本的增加。本公司现更名为太平基金管理有限公司。

基金管理人于 2016 年 9 月 29 日发布公告，因公司股权变更，本基金更名为“太平灵活配置混
第37页共38页

合型发起式证券投资基金”，基金简称变更为“太平灵活配置”，本基金相关法律文件一并进行更名，本基金基金代码不变。本次更名不改变本基金投资范围，对基金投资人利益无实质性不利影响。

太平基金管理有限公司

二〇一七年三月三十一日