

# 太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

## 2016 年年度报告

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 重要提示及目录

### 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
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	16
§6 审计报告	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
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	57
8.9 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权证投资明细	57

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
8.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
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 .....	59
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	59
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>59</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>60</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
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 .....	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
11.8 其他重大事件 .....	62
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>64</b>
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>64</b>
13.1 备查文件目录 .....	64
13.2 存放地点 .....	65
13.3 查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	太平灵活配置混合型发起式证券投资基金
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</p>

	<p>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	姓名	陈吟绮	吴荣

负责人	联系电话	021-38556782	021-52629999-213117
	电子邮箱	disclosure@taipingfund.com.cn	011693@cib.com.cn
客户服务电话		021-38874600	95561
传真		021-38556677	021-62535823
注册地址		上海市虹口区邯郸路135号 5幢101室	福州市湖东路154号
办公地址		上海市浦东新区花园石桥 路33号花旗集团大厦17楼 1708室	上海江宁路168号兴业大厦 20楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		汤海涛	高建平

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人 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

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	太平基金管理有限公司	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
本期加权平均净值利润 率	-7.73%	-25.47%
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
期末可供分配利润	-783,133,505.10	-4,050,179.74
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
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长 率	-34.10%	-21.50%

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

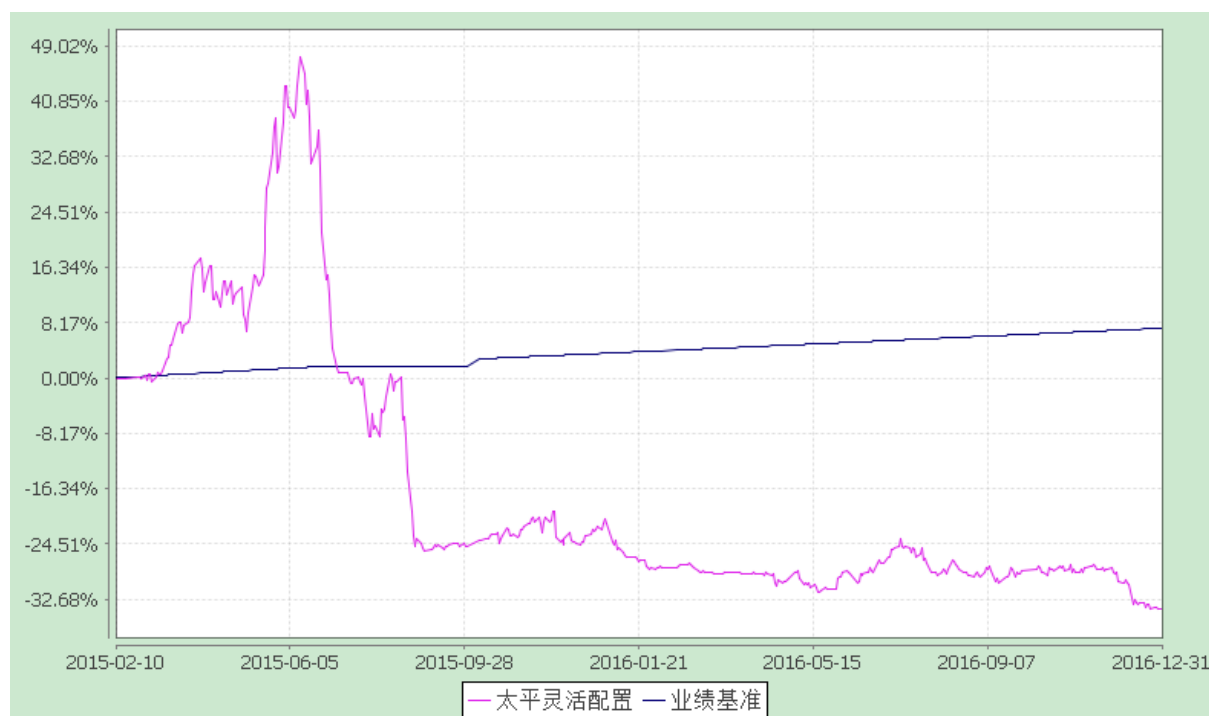
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.96%	0.81%	0.89%	0.01%	-8.85%	0.80%
过去六个月	-9.35%	0.86%	1.78%	0.01%	-11.13%	0.85%
过去一年	-16.05%	0.78%	3.57%	0.01%	-19.62%	0.77%
自基金合同生效起至今	-34.10%	1.46%	7.35%	0.01%	-41.45%	1.45%

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

自基金合同生效以来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)

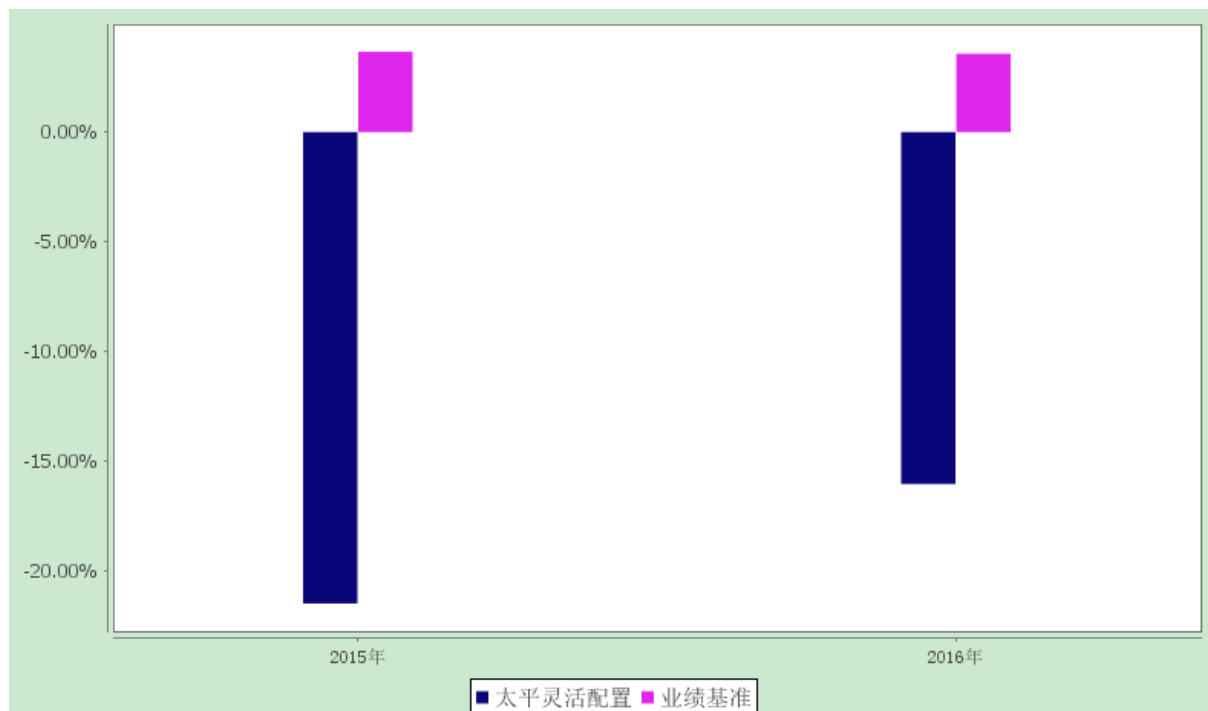


注：本基金基金合同于 2015 年 2 月 10 日生效；按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，本基金已完成建仓，本基金的各项资产配置比例符

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合规守信情况的说明

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非公平交易的情况。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。

在内控制度建设方面，公司持续完善内控制度建设，并时刻关注法规的新变化、结合行业发展的新动态、围绕业务开展的新需要，适时组织更新相关业务制度。在公司合规文化建设方面，公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，不断增强全体员工的合规自觉与风控意识，为公司业务的规范开展和健康发展创造良好的内控环境。在稽核检查方面，公司稽核与风控部在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对各项业务活动进行监督、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，定期对各类业务开展情况以及

公司整体运营情况进行覆盖全面、重点突出的检查、总结和反馈，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将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资产，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的太平灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“太平灵活配置混合发起式基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是太平灵活配置混合发起式基金的基金管理人太平基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取



合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述太平灵活配置混合发起式基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了太平灵活配置混合发起式基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师  
薛竞、都晓燕  
上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼  
2017 年 3 月 24 日

## § 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	附注号	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	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	504,901,677.35	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,509,267,311.10</b>	<b>12,809,793.59</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	160,007.84	50,001.42
<b>负债合计</b>		<b>338,717.21</b>	<b>84,620.61</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	2,289,482,565.25	16,209,168.25
未分配利润	7.4.7.1 0	-780,553,971.36	-3,483,995.27
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,508,928,593.89</b>	<b>12,725,172.98</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,509,267,311.10</b>	<b>12,809,793.59</b>

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	附注号	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
<b>一、收入</b>		<b>-1,129,747.28</b>	<b>-3,074,291.70</b>
1. 利息收入		339,113.91	113,236.56
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	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	7.4.7.1 2	-1,117,833.99	-3,375,156.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1 3	-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	7.4.7.1 4	-	-
股利收益	7.4.7.1 5	55,613.19	45,883.04
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 6	-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）	7.4.7.1 7	8,811.73	15,228.54
<b>减：二、费用</b>		<b>600,253.12</b>	<b>553,716.93</b>
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	7.4.7.1 8	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	7.4.7.1 9	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本金额共计人民币13,555,569.64元，上述募集资本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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。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 日止期间。



#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1、利息收入

(1)存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2)除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

(3)买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### 2、投资收益

(1)股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2)债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3)衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4)股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### 3、公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。

3、卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响每万份基金净收益小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为8次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### 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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	995,391,551.44	7,662,305.66
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	995,391,551.44	7,662,305.66

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	8,400,681.58	8,116,906.00	-283,775.58	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	550,220.00	549,285.00	-935.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	550,220.00	549,285.00	-935.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	8,950,901.58	8,666,191.00	-284,710.58	
项目	上年度末			
	2015 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	

股票		4,125,464.86	4,254,541.00	129,076.14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	759,876.50	758,665.40	-1,211.10
	银行间市场	-	-	-
	合计	759,876.50	758,665.40	-1,211.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,885,341.36	5,013,206.40	127,865.04

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016 年 12 月 31 日）本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	504,901,677.35	-
合计	504,901,677.35	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未进行买断式逆回购交易。

#### 7.4.7.5 应收利息

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
应收活期存款利息	143,343.30	3,539.88
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	15.51	39.27
应收债券利息	8,352.47	12,964.40
应收买入返售证券利息	111,309.77	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	6.60	11.11
合计	263,027.65	16,554.66

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

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
交易所市场应付交易费用	16,049.59	14,851.19
银行间市场应付交易费用	1,677.35	-
合计	17,726.94	14,851.19

#### 7.4.7.8 其他负债

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7.84	1.42
其他应付款	-	-
预提费用	100,000.00	-
审计费用	60,000.00	50,000
合计	160,007.84	50,001.42

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,209,168.25	16,209,168.25
本期申购	2,277,779,974.91	2,277,779,974.91
本期赎回（以“-”号填列）	-4,506,577.91	-4,506,577.91
本期末	2,289,482,565.25	2,289,482,565.25

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,050,179.74	566,184.47	-3,483,995.27
本期利润	-1,317,424.78	-412,575.62	-1,730,000.40
本期基金份额交易产生的变动数	-777,765,900.58	2,425,924.89	-775,339,975.69
其中：基金申购款	-779,175,565.31	2,555,799.72	-776,619,765.59
基金赎回款	1,409,664.73	-129,874.83	1,279,789.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-783,133,505.10	2,579,533.74	-780,553,971.36

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	212,141.22	70,032.02
定期存款利息收入	-	25,511.12
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	479.05	952.48
其他	179.46	660.44
合计	212,799.73	97,156.06

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	31,111,812.24	62,960,085.25
减：卖出股票成本总额	32,229,646.23	66,335,242.13
买卖股票差价收入	-1,117,833.99	-3,375,156.88

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（债转股及 债券到期兑付）差价收入	-2,876.50	-1,348.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-

合计	-2,876.50	-1,348.00
----	-----------	-----------

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额	777,136.20	697,859.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑 付）成本总额	759,876.50	675,348.00
减：应收利息总额	20,136.20	23,859.60
买卖债券差价收入	-2,876.50	-1,348.00

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	55,613.19	45,883.04
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	55,613.19	45,883.04

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-412,575.62	127,865.04
——股票投资	-412,851.72	129,076.14

——债券投资	276.10	-1,211.10
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-412,575.62	127,865.04

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年2月10日（基金合同生效日） 至2015年12月31日
基金赎回费收入	8,811.73	15,228.54
合计	8,811.73	15,228.54

注：注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 计入基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月 31日	2015年2月10日（基金合同生效日） 至2015年12月31日
交易所市场交易费用	92,004.87	182,136.03
银行间市场交易费用	-	-
合计	92,004.87	182,136.03

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年2月10日（基金合同生效日）至2015年12月31日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
银行划款费用	1,200.00	955
帐户维护费	25,700.00	-
开户费	-	400
合计	186,900.00	151,355.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140 号），要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2 号），2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 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”。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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%

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 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 × 1.50% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年	上年度可比期间 2015年2月10日（基金合

	12月31日	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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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
报告期初持有的基金份额	10,001,375.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,375.14	10,001,375.14
报告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，不享有比其他投资人更优惠的费率。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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

300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股认购	14.11	14.11	500.00	7,055.00	7,055.00	新股未上市
--------	------	------------	------------	------	-------	-------	--------	----------	----------	-------

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。

#### 7.4.12.2 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	复牌开盘单价	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。

#### 7.4.12.3 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货、权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益相匹配”的风

险收益目标。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门在内的多级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会主要负责确定公司风险管理总体目标、制定公司风险管理战略和风险应对策略等事项。经营管理层及其下设的风险控制委员会负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核与风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方

面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券均在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2016年12月31日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率

风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	995,391, 551.44	-	-	-	-	-	995,391, 551.44
结算备付金	31,507.5 1	-	-	-	-	-	31,507.5 1
存出保证金	13,356.1 5	-	-	-	-	-	13,356.1 5
交易性金融 资产	-	-	549,285. 00	-	-	8,116,90 6.00	8,666,19 1.00
买入返售金 融资产	504,901, 677.35	-	-	-	-	-	504,901, 677.35
应收利息	-	-	-	-	-	263,027. 65	263,027. 65
资产总计	1,500,33 8,092.45	-	549,285. 00	-	-	8,379,93 3.65	1,509,26 7,311.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,170.06	4,170.06
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	134,410. 62	134,410. 62
应付托管费	-	-	-	-	-	22,401.7 5	22,401.7 5
应付交易费 用	-	-	-	-	-	17,726.9 4	17,726.9 4
其他负债	-	-	-	-	-	160,007. 84	160,007. 84
负债总计	-	-	-	-	-	338,717. 21	338,717. 21
利率敏感度 缺口	1,500,33 8,092.45	-	549,285. 00	-	-	8,041,21 6.44	1,508,92 8,593.89

上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,662,305.66	-	-	-	-	-	7,662,305.66
结算备付金	79,304.89	-	-	-	-	-	79,304.89
存出保证金	22,445.95	-	-	-	-	-	22,445.95
交易性金融资产	-	-	758,665.40	-	-	4,254,541	5,013,206.4
应收利息	-	-	-	-	-	16,554.66	16,554.66
应收申购款	-	-	-	-	-	15,976.03	15,976.03
资产总计	7,764,056.50	-	758,665.40	-	-	4,287,071.69	12,809,793.59
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,624.72	1,624.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,551.39	15,551.39
应付托管费	-	-	-	-	-	2,591.89	2,591.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,851.19	14,851.19
其他负债	-	-	-	-	-	50,001.42	50,001.42
负债总计	-	-	-	-	-	84,620.61	84,620.61
利率敏感度缺口	7,764,056.50	-	758,665.40	-	-	4,202,451.08	12,725,172.98

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.04%(2015 年 12 月 31 日：5.96%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金对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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：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	
	公允价值	占基金	公允价值	占基

		资产净 值比例 (%)		金资 产净 值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	8,116,906.00	0.54	4,254,541.00	33.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	8,116,906.00	0.54	4,254,541.00	33.43

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日,本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.54%,因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(于 2015 年 12 月 31 日,本基金成立尚未满一年,无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响)。

#### 7.4.14 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,第二层级 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 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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所有股票投资明细

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
11	000823	超声电子	22,500	279,675.00	0.02
12	600643	爱建集团	22,000	273,020.00	0.02
13	002239	奥特佳	17,000	266,730.00	0.02
14	002043	兔宝宝	23,000	266,110.00	0.02
15	300316	晶盛机电	22,000	263,560.00	0.02
16	300158	振东制药	13,000	254,540.00	0.02
17	600498	烽火通信	10,000	252,100.00	0.02
18	600809	山西汾酒	10,000	250,200.00	0.02
19	002150	通润装备	15,000	248,250.00	0.02
20	600166	福田汽车	80,000	247,200.00	0.02
21	603818	曲美家居	14,000	244,300.00	0.02
22	601628	中国人寿	10,000	240,900.00	0.02
23	002624	完美世界	8,000	238,320.00	0.02
24	002444	巨星科技	15,000	234,000.00	0.02
25	300061	康耐特	10,000	230,300.00	0.02
26	300043	星辉娱乐	22,500	228,150.00	0.02
27	300232	洲明科技	15,000	223,800.00	0.01
28	002758	华通医药	7,000	207,480.00	0.01
29	300587	天铁股份	500	7,055.00	0.00

## 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所有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 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	2,286,175,88 1.97	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、基金投资和研发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	10,001,375.14	0.44%	10,001,375.14	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	10,001,375.14	0.44%	10,001,375.14	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，公司总经理林伟萌先生于 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 与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%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中原英石基金管理有限公司关于旗下基金调整 2016 年 1 月 4 日开放时间的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2016-01-04
2	中原英石基金管理有限公司关于旗下基金调整 2016 年 1 月 7 日开放时间的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2016-01-07

3	中原英石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增加销售机构并参加相关费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2016-01-29
4	中原英石基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的“康耐特”股票估值调整的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2016-05-14
5	中原英石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增加销售机构并参加相关费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2016-06-02
6	中原英石基金管理有限公司关于旗下基金 2016 年半年度最后一个市场交易日基金资产净值等的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2016-07-01
7	中原英石基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的“露笑科技”股票估值调整的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2016-07-09
8	中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 第二季度报告	《证券时报》、基金管理人网站	2016-07-19
9	太平基金管理有限公司公告（系列） 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（总经理） 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（副总经理） 太平基金管理有限公司关于公司董事变更的公告 太平基金管理有限公司关于公司注册资本、股权变更及修改《公司章程》的公告 太平基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告（董事长） 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（董事长） 关于中原英石基金管理有限公司法定名称变更、修改公司章程等相关事项的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2016-08-23
10	中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年半年度报告（摘要）	《证券时报》、基金管理人网站	2016-08-24
11	中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）-摘要（2016 年第 2 号）	《证券时报》、基金管理人网站	2016-09-23
12	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	《证券时报》、基金管理人网站	2016-09-29
13	太平基金管理有限公司关于旗下太平灵	《证券时报》、基金	2016-09-29

	活配置混合型发起式证券投资 基金增加销售机构并参加相关费率优 惠活动的公告	管理人网站	
14	太平基金管理有限公司关于旗下太平灵 活配置混合型发起式证券投 资基金增加销售机构并参加相关费率优 惠活动的公告	《证券时报》、基金 管理人网站	2016-09-29
15	太平基金管理有限公司关于旗下太平灵 活配置混合型发起式证券投 资基金增加销售机构并参加相关费率优 惠活动的公告	《证券时报》、基金 管理人网站	2016-09-30
16	太平基金管理有限公司 关于旗下基金增加销售机构并参加相关 费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金 管理人网站	2016-11-22
17	太平基金管理有限公司关于旗下基金 2016 年年度最后一个市场交易日基金 资产净值等的公告	《证券时报》、基金 管理人网站	2016-12-31

## § 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件
- 2、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照



6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

**13.2 存放地点**

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室）

**13.3 查阅方式**

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：021-38874600

公司网址：[www.taipingfund.com.cn](http://www.taipingfund.com.cn)

太平基金管理有限公司  
二〇一七年三月三十一日