

泰康养老保险股份有限公司集合型企业年金计划管理情况

2015年3季度

一、2015年3季度集合计划基本情况表

序号	计划登记号	计划名称	期末企业数 (个)	期末职工人数 (人)	期末资产金额 (万元)	设立组合数 (个)	本期投资收益 (万元)	本年累计投资收益 (万元)
1	99JH20110018	泰康恒泰企业年金集合计划	320	46,578	140,785.58	7	1,558.66	9,326.19
2	99JH20110019	泰康永泰企业年金集合计划	174	26,903	63,393.06	6	636.67	4,017.95
3	99JH20110020	泰康通泰企业年金集合计划	73	6,835	21,203.79	5	241.83	947.85
4	99JH20110021	泰康金色瑞泰企业年金集合计划	119	35,635	39,250.60	6	423.23	2,842.04
5	99JH20110022	泰康养颐乐泰企业年金集合计划	161	22,427	58,150.55	7	581.36	3,981.57
6	99JH20110023	泰康祥瑞信泰企业年金集合计划	136	13,456	47,692.06	8	368.48	3,360.95
7	99JH20120036	泰康鸿泰企业年金集合计划	169	11,180	29,073.21	6	315.35	2,117.53
8	99JH20120037	泰康阳光开泰企业年金集合计划	54	3,423	14,004.61	5	157.50	1,061.66
9	99JH20120038	泰康富泰企业年金集合计划	9	1,076	3,568.81	5	34.95	133.54
合计	—	—	1,215	167,513	417,122.27	55	4,318.03	27,789.28

注：1. 期末资产金额包含受托户资金余额。

2. 投资收益为所有组合投资收益合计数。投资收益=当期投资资产利息收入+投资处置收益+公允价值变动损益+其他收入-受托费-托管费-投资管理费-交易费用-利息支出-其他费用。本期投资收益以本季度为期间，本年累计投资收益以年初到本季度末为期间。

二、2015年3季度集合计划组合明细表

序号	计划登记号	计划名称	组合序号	组合名称	组合类型	组合代码	投资管理公司名称	组合期末资产净值(万元)	本年以来投资收益率(%)
1	99JH20110018	泰康恒泰企业年金集合计划	1	泰康工行恒泰平稳收益组合	固定收益类	490011	泰康资产管理有限责任公司	2,293.58	6.05
			2	泰康资产稳健成长投资组合(恒泰)	含权益	490024	泰康资产管理有限责任公司	116,813.85	8.47
			3	泰康资产优选配置投资组合(恒泰)	含权益	490053	泰康资产管理有限责任公司	10,981.11	9.60
			4	工银瑞信积极债券投资组合(恒泰)	固定收益类	470069	工银瑞信基金管理有限公司	10,697.04	4.91
2	99JH20110019	泰康永泰企业年金集合计划	1	泰康资产稳健成长投资组合(永泰)	含权益	490022	泰康资产管理有限责任公司	59,662.61	8.88
			2	中银永泰平稳收益组合	固定收益类	490020	泰康资产管理有限责任公司	468.14	5.45
			3	泰康资产优选配置投资组合(永泰)	含权益	490021	泰康资产管理有限责任公司	3,262.31	9.13
3	99JH20110020	泰康通泰企业年金集合计划	1	交行通泰稳健成长组合	含权益	490070	泰康资产管理有限责任公司	970.46	8.49
			2	泰康资产优选配置投资组合(通泰)	含权益	490171	泰康资产管理有限责任公司	20,233.32	9.11
4	99JH20110021	泰康金色瑞泰企业年金集合计划	1	泰康资产稳健成长投资组合(金色瑞泰)	含权益	490013	泰康资产管理有限责任公司	33,954.27	9.03
			2	泰康资产优选配置投资组合(金色瑞泰)	含权益	490012	泰康资产管理有限责任公司	5,296.34	9.48
5	99JH20110022	泰康养颐乐泰企业年金集合计划	1	建行养颐乐泰稳健成长组合	含权益	490083	泰康资产管理有限责任公司	1,784.02	9.55
			2	泰康资产优选配置投资组合(养颐乐泰)	含权益	490184	泰康资产管理有限责任公司	55,708.64	8.60

6	99JH20110023	泰康祥瑞信泰企业年金集合计划	1	中信证券稳健配置投资组合(祥瑞信泰)	含权益	410079	中信证券股份有限公司	3,596.10	5.01
			2	泰康资产稳健成长投资组合(祥瑞信泰)	含权益	490030	泰康资产管理有限责任公司	44,095.97	8.84
7	99JH20120036	泰康鸿泰企业年金集合计划	1	泰康资产稳健成长投资组合(鸿泰)	含权益	490009	泰康资产管理有限责任公司	29,073.21	8.98
8	99JH20120037	泰康阳光开泰企业年金集合计划	1	阳光开泰平稳收益组合	固定收益类	490014	泰康资产管理有限责任公司	282.45	5.41
			2	泰康资产稳健成长投资组合(阳光开泰)	含权益	490010	泰康资产管理有限责任公司	13,722.16	9.11
9	99JH20120038	泰康富泰企业年金集合计划	1	泰康资产稳健成长投资组合(富泰)	含权益	490164	泰康资产管理有限责任公司	3,568.81	9.28

注：1. 组合类型按是否含权益类投资标的分为固定收益类和含权益类，以期初合同或备忘录为准，明确约定不能投资权益类的组合为固定收益类；没有明确约定或期间发生类别变动的，都为含权益类。

2. 本年以来投资收益率为该组合单位净值增长率。

对因分红、净值归一等非正常业务影响组合单位净值的，收益率分阶段计算。

(1) 分红情况

期间多段分红收益率公式： $R = (\text{期内第1次分红前一天单位净值} / \text{期初单位净值}) * (\text{期内第2次分红前一天单位净值} / (\text{期内第1次分红前一天单位净值} - \text{第一次单位份额分红金额})) * \dots * (\text{期末单位净值} / (\text{期内第n次分红前一天单位净值} - \text{第n次单位份额分红金额})) - 1$

其中，单位份额分红金额 = 分红当天分红金额 / 分红前总份额

(2) 净值归一情况

期间多段净值归一收益率公式： $R = ((\text{期内第1次归一当天单位净值} * \text{第1次净值归一系数}) / \text{期初单位净值}) * ((\text{期内第2次归一当天单位净值} * \text{第2次净值归一系数}) / \text{期内第1次归一当天单位净值}) * \dots * (\text{期末单位净值} / \text{期内第n次归一当天单位净值}) - 1$

其中，净值归一系数 = 净值归一当天总份额 / 净值归一前一天总份额

(3) 期内混合发生分红、净值归一时，按上述公式进行混合分段并计算期间收益率。

3. 本年以来投资收益空缺的为2015年1月1日及以后正式运作的组合。

三、2015年3季度集合计划分组合类型收益情况表

序号	计划登记号	计划名称	组合类型	样本组合数(个)	样本组合期末资产净值(万元)	本年以来加权平均收益率(%)
1	99JH20110018	泰康恒泰企业年金集合计划	固定收益类	2	12,990.62	5.12
			含权益类	2	127,794.95	8.56
			综合	4	140,785.58	8.22
2	99JH20110019	泰康永泰企业年金集合计划	固定收益类	1	468.14	5.45
			含权益类	2	62,924.92	8.89
			综合	3	63,393.06	8.86
3	99JH20110020	泰康通泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0	0
			含权益类	2	21,203.79	9.07
			综合	2	21,203.79	9.07
4	99JH20110021	泰康金色瑞泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0	0
			含权益类	2	39,250.60	9.09
			综合	2	39,250.60	9.09
5	99JH20110022	泰康养颐乐泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0	0
			含权益类	2	57,492.66	8.64
			综合	2	57,492.66	8.64
6	99JH20110023	泰康祥瑞信泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0	0
			含权益类	2	47,692.06	8.54
			综合	2	47,692.06	8.54
7	99JH20120036	泰康鸿泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0	0
			含权益类	1	29,073.21	8.98
			综合	1	29,073.21	8.98
8	99JH20120037	泰康阳光开泰企业年金集合计划	固定收益类	1	282.45	5.41
			含权益类	1	13,722.16	9.11
			综合	2	14,004.61	9.03
9	99JH20120038	泰康富泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0	0
			含权益类	1	3,568.81	9.28
			综合	1	3,568.81	9.28
合计	——	——	固定收益类	4	13,741.21	5.13
			含权益类	15	402,723.17	8.76

注：1. 样本为2015年1月1日以前正式运作的投资组合。

2. 本年以来加权平均收益率计算方法为符合条件样本组合收益率的规模加权，以上年末和本年各季度末平均资产规模为权重；各组合收益率为单位净值增长率。