

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

2016年1季度

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	339	45,894	154,304.7759	4	594.7385	594.7385
2	99JH20110019	泰康永泰企业年金 集合计划	205	30,801	76,719.3869	3	80.1473	80.1473
3	99JH20110020	泰康通泰企业年金 集合计划	80	7,058	24,454.5555	2	(27.7495)	(27.7495)
4	99JH20110021	泰康金色瑞泰企业 年金集合计划	135	37,446	49,759.5034	2	60.1373	60.1373
5	99JH20110022	泰康养颐乐泰企业 年金集合计划	177	23,451	66,497.2147	3	214.7951	214.7951
6	99JH20110023	泰康祥瑞信泰企业 年金集合计划	143	14,397	54,695.7996	2	(32.8962)	(32.8962)
7	99JH20120036	泰康鸿泰企业年金 集合计划	181	11,609	35,019.4683	1	80.0265	80.0265
8	99JH20120037	泰康阳光开泰企业 年金集合计划	58	3,495	15,380.9603	2	10.0105	10.0105
9	99JH20120038	泰康富泰企业年金 集合计划	9	1,246	5,037.3841	1	14.9874	14.9874
10	99JH20140052	泰康祥瑞信泰B款 企业年金集合计划	---	---	---	8	---	---
合计	---	---	1,327	175,397	481,869.0487	28	994.1969	994.1969

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、2016年1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	2,529.8048	1.03
			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	129,977.3932	0.35
			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	13,433.3818	(0.27)
			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	8,152.8708	1.24
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	71,509.9630	0.04
			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	562.7847	1.00
			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	3,513.3094	(0.16)
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	1,418.7880	0.00
			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	22,623.3449	(0.15)
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	42,815.3052	0.07
			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	6,721.3124	(0.28)
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	1,865.2258	0.01
			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	63,788.0041	0.23
			3	易方达稳健收益投资组合(养颐乐泰)	含权益	340092	易方达基金管理有限公司	216.7462	(0.08)

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	3,733.4952	(1.93)
			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	50,861.5525	0.04
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	34,777.5857	0.17
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	379.4818	0.98
			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	14,984.8309	0.01
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	5,010.8087	(0.07)
10	99JH20140052	泰康祥瑞信泰B款企业年金集合计划	1	国泰基金稳健全债投资组合	固定收益类	---	国泰基金管理有限公司	---	---
			2	华夏基金稳健配置投资组合	含权益	---	华夏基金管理有限公司	---	---
			3	人保资产进取成长投资组合	含权益	---	中国人保资产管理股份有限公司	---	---
			4	人保资产稳健增值投资组合	固定收益类	---	中国人保资产管理股份有限公司	---	---
			5	泰康资产稳健成长投资组合	含权益	---	泰康资产管理有限责任公司	---	---
			6	泰康资产优选配置投资组合	含权益	---	泰康资产管理有限责任公司	---	---
			7	银华基金稳健配置投资组合	含权益	---	银华基金管理有限公司	---	---
			8	中信证券稳健配置投资组合	含权益	---	中信证券股份有限公司	---	---

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. 今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。

三、2016年1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	10,682.6756	1.20
			含权益类	2	143,410.7750	0.29
			综合	4	154,093.4506	0.37
2	99JH20110019	泰康永泰企业年金集合计划	固定收益类	1	562.7847	1.00
			含权益类	2	75,023.2724	0.03
			综合	3	75,586.0571	0.04
3	99JH20110020	泰康通泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0.0000	0.00
			含权益类	2	24,042.1329	-0.14
			综合	2	24,042.1329	-0.14
4	99JH20110021	泰康金色瑞泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0.0000	0.00
			含权益类	2	49,536.6176	0.02
			综合	2	49,536.6176	0.02
5	99JH20110022	泰康养颐乐泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0.0000	0.00
			含权益类	3	65,869.9761	0.22
			综合	3	65,869.9761	0.22
6	99JH20110023	泰康祥瑞信泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0.0000	0.00
			含权益类	2	54,595.0477	-0.10
			综合	2	54,595.0477	-0.10
7	99JH20120036	泰康鸿泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0.0000	0.00
			含权益类	1	34,777.5857	0.17
			综合	1	34,777.5857	0.17
8	99JH20120037	泰康阳光开泰企业年金集合计划	固定收益类	1	379.4818	0.98
			含权益类	1	14,984.8309	0.01
			综合	2	15,364.3127	0.03
9	99JH20120038	泰康富泰企业年金集合计划	固定收益类	0	0.0000	0.00
			含权益类	1	5,010.8087	-0.07
			综合	1	5,010.8087	-0.07
10	99JH20140052	泰康祥瑞信泰B款企业年金集合计划	固定收益类	---	---	---

			含权益类	---	---	---
			综合	---	---	---
合计	---	---	固定收益类	4	11,624.9421	1.18
			含权益类	16	467,251.0470	0.12

注：1. 样本为 2016 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。

3. 泰康祥瑞信泰 B 款企业年金集合计划尚未投入运作。