

# 泰康智选汇盈养老保障管理产品

## 2016年年度管理报告



# 卷首语

尊敬的委托人:

您好!

感谢贵公司对泰康养老保险股份有限公司的信任,选择并参与到泰康智选汇盈养老保障管理产品中。

为了向贵公司及其企业职工提供高效优质的养老保障产品服务,根据养老保障产品相关法规,我们作为本产品管理人,总结并整理了本产品报告期间内的整体运作情况和各项管理数据,编制了2016年年度管理报告(简称“本报告”)。本报告内容反映了报告期内贵公司参与的泰康智选汇盈养老保障管理产品的资产变动情况、账户管理变动情况及各投资组合的收益情况,并且附带了法规要求的详实、准确的各类财务报表。

敬请审阅本报告,若在阅读后还有疑问,或在泰康智选汇盈养老保障管理产品运作过程中有任何问题,可随时咨询我们的服务代表或通过邮件及电话方式与我们联系,我们将竭诚为您提供满意的服务。

让企业省心,让员工安心!

## 目 录

一、	产品基本信息.....	4
二、	产品管理情况.....	4
三、	参加企业变动情况.....	5
四、	计划账户管理情况.....	5
五、	计划投资组合报告.....	6
六、	投资资产分布情况.....	7
七、	受托财产托管账户资金变动情况.....	9
八、	计划投资资产财务会计报告.....	9
九、	市场分析及投资策略建议.....	12
十、	其他需要说明的情况.....	14
十一、	声明.....	14

## 一、 产品基本信息

计划名称: 泰康智选汇盈养老保障管理产品	
计划投资时间: 2011年12月	
管理人基本信息	管理人名称: 泰康养老保险股份有限公司
	法定代表人: 李艳华
	注册地址: 北京市复兴门内大街156号泰康人寿大厦A座11层
	联系人: 张泽宇
	联系电话: 010-59311936
联系地址及邮编: 北京市复兴门内大街156号泰康人寿大厦A座11层	
托管人名称:	中国建设银行股份有限公司
投资管理人名称:	泰康资产管理有限责任公司

## 二、 产品管理情况

### (一) 履职情况

泰康养老保险股份有限公司作为管理人,在本报告期内严格遵守有关法律法规的规定和其他管理合同的约定,开展管理业务,勤勉尽责地管理基金资产,不存在损害委托人和受益人利益的行为,不存在关联交易。

### (二) 重大事项说明

泰康养老保险股份有限公司最大持股股东泰康人寿保险股份有限公司,于2016年8月19日获得中国保监会批复,同意进行集团化改组,并将公司名称变更为泰康保险集团股份有限公司。

田军先生自2016年7月25日起担任泰康养老保险股份有限公司副总经理兼养老金发展中心总经理职务。

### 三、 参加企业变动情况

参加企业的变动		
报告期内参加企业的变动	期初企业数:	103
	新增企业数:	24
	退出企业数:	28
	期末企业数:	99

### 四、 计划账户管理情况

#### (一) 个人账户信息

单位: 个

报告期内个人账户变动情况	期初个人账户数	13,766
	本期增加账户数	2,075
	其中转入计划户数	0
	本期减少账户数	1,386
	其中转出计划户数	0
	期末个人账户数	14,455
报告期内待遇支付账户情况	分期支付退休账户数	16
	一次性支付退休账户数	35
	其他待遇支付账户数	3,314

数据来源: 本表数据取自账户管理人账管报告。

注: 减少账户数包含退出企业个人账户数和离职、退休待遇支付账户数; 其他待遇支付账户数为离职及满期支付账户数。

#### (二) 资产情况

单位: 元

1	基金期初余额	447,937,207.17
2	个人账户中企业缴费及收益积累余额	383,540,548.78
3	个人账户中个人缴费及收益积累余额	6,074,628.81
4	企业公共账户缴费及收益积累余额	58,322,029.58
5	本期收入	179,423,624.95
6	缴费收入(扣除初始费)	185,278,515.68
7	其中: 个人账户中企业缴费(扣除初始费)	49,380,895.48
8	个人账户中个人缴费(扣除初始费)	42,777,042.24
9	企业公共账户缴费(扣除初始费)	93,120,577.96

10	转移收入	0.00
11	期间资产增值	-5,855,410.73
12	其他收入	0.00
13	本期支出	125,259,868.11
14	待遇支付	75,405,618.17
15	转移支出	46,291,322.11
16	其他支出	3,562,927.83
17	本期积累	54,163,756.84
18	个人账户中企业缴费及收益积累	-26,424,079.61
19	个人账户中个人缴费及收益积累	35,063,436.97
20	企业公共账户缴费及收益积累	45,524,399.48
21	基金期末余额	502,100,964.01
22	个人账户中企业缴费及收益积累余额	357,116,469.17
23	个人账户中个人缴费及收益积累余额	41,138,065.78
24	企业公共账户缴费及收益积累余额	103,846,429.06

数据来源: 本表数据取自账户管理人账管报告。

注: 2016年12月31日定价日有大量赎回及待遇支付, 因此账管人基金期末余额与托管数据有差异。

## 五、 计划投资组合报告

### 计划资产净值和收益情况

组合资产净值 (元)		资产份额 (份)		单位净值 (元)		报告期内投资 收益 (元)
期初	期末	期初	期末	期初	期末	
393,776,899.18	507,543,395.80	271,150,273.05	351,788,249.52	1.4522	1.4428	-3,848,195.60
报告期内投资收益率 (%)		本年以来投资收益率 (%)		组合成立以来累计收益率 (%)		
-0.65		-0.65		44.28		

数据来源: 本表取自投资管理人报告及托管人报告。

## 六、 投资资产分布情况

### (一) 计划投资资产分布情况

资产种类		市值 (元)	占净资产比例 (%)	
一、 流动性资产	银行活期存款	268,138.08	0.05	10.21
	中央银行票据	-	-	
	债券回购	-	-	
	货币基金	51,557,519.39	10.16	
	清算备付金	-	-	
	应收证券清算款	-	-	
	其他流动性资产	-	-	
二、 固定收益类资产	银行定期存款	-	-	90.02
	协议存款	-	-	
	国债	-	-	
	金融债	-	-	
	企业(公司)债	-	-	
	短期融资券	-	-	
	中期票据	-	-	
	万能保险产品	-	-	
	可转换债(含分离交易可转换债)	-	-	
	债券基金	-	-	
	投资连结保险产品 (股票投资比例不高于30%)	-	-	
	其他固定收益类资产	456,865,042.84	90.02	
三、 权益类资产	股票	-	-	-
	股票基金、混合基金	-	-	
	投资连结保险产品 (股票投资比例高于或等于30%)	-	-	
	权证	-	-	
	其他权益类资产	-	-	
四、其他	77,759.22	0.02	0.02	
合计	508,768,459.53	100.25		

数据来源: 本表数据来源于托管人报告, 是市值(含负债)占净值(扣除负债)的比例, 总体占比超过100%。

**(二) 组合投资资产分布情况**

资产种类		市值(元)	占净资产比例(%)	
一、 流动性资产	银行活期存款	268,138.08	0.05	10.21
	中央银行票据	-	-	
	债券回购	-	-	
	货币基金	51,557,519.39	10.16	
	清算备付金	-	-	
	应收证券清算款	-	-	
	其他流动性资产	-	-	
二、 固定收益类资产	银行定期存款	-	-	90.01
	协议存款	-	-	
	国债	-	-	
	金融债	-	-	
	企业(公司)债	-	-	
	短期融资券	-	-	
	中期票据	-	-	
	万能保险产品	-	-	
	可转换债(含分离交易可转换债)	-	-	
	债券基金	-	-	
	投资连结保险产品 (股票投资比例不高于30%)	-	-	
	其他固定收益类资产	456,865,042.84	90.01	
三、 权益类资产	股票	-	-	-
	股票基金、混合基金	-	-	
	投资连结保险产品 (股票投资比例高于或等于30%)	-	-	
	权证	-	-	
	其他权益类资产	-	-	
四、其他	77,759.22	0.02	0.02	
合计		508,768,459.53	100.24	

数据来源: 本表数据来源于投资管理人报告, 是市值(含负债)占净值(扣除负债)的比例, 总体占比超过100%。



## 七、受托财产托管账户资金变动情况

单位: 元

1	期初金额	68,262,173.82
2	利息收入	33,523.51
3	期末金额	31,826,748.85

数据来源: 本表取自托管人报告。

## 八、计划投资资产财务会计报告

### (一) 泰康养老保障管理产品—稳健收益型

#### 12 月资产负债表新准则

行次	科目名称	人民币 (元)	
		年初数	期末数
1	货币资金:	264,340.10	268,138.08
2	其中: 现金	-	-
3	活期存款	264,340.10	268,138.08
4	其他货币资金	-	-
5	定期存款	-	-
6	其中: 三个月以内定存	-	-
7	存出保证金	-	-
8	交易性金融资产	394,443,496.71	508,422,562.23
9	指定以公允价值计量金融资产	-	-
10	买入返售金融资产	-	-
11	应收股利	50,130.51	77,662.81
12	应收利息	277.91	96.41
13	减: 坏帐准备金	-	-
14	贷款	-	-
15	贷款呆帐准备	-	-
16	其它应收款	-	-
17	系统内养老险往来	-	-
18	系统内健康险往来	-	-
19	系统内产险往来	-	-
20	内部往来	-	-
21	系统内寿险往来	-	-
22	拆出资金	-	-
23	待摊费用	-	-
24	持有至到期投资	-	-
25	持有至到期投资减值准备	-	-

26	可供出售金融资产	-	-
27	可供出售金融资产减值准备	-	-
28	长期股权投资	-	-
29	减: 长期股权投资减值准备	-	-
30	投资性房地产	-	-
31	减: 投资性房地产累计折旧	-	-
32	减: 投资性房地产减值准备	-	-
33	存出资本保证金	-	-
34	衍生工具	-	-
35	套期工具	-	-
36	资产总计	394,758,245.23	508,768,459.53
37	拆入资金	-	-
38	卖出回购金融资产	-	-
39	应付保户利差	-	-
40	预提费用	-	-
41	其他应付款	981,346.05	1,225,063.73
42	应交税金	-	-
43	应付利息	-	-
44	货币兑换	-	-
45	负债合计	981,346.05	1,225,063.73
46	实收基金	271,150,273.05	351,788,249.52
47	资本公积	19,269,639.22	56,246,354.97
48	本年利润	-	-
49	利润分配	103,356,986.91	99,508,791.31
50	其中: 上年未分配利润	-	103,356,986.91
51	以前年度损益调整	-	-
52	所有者权益合计	393,776,899.18	507,543,395.8
53	负债及所有者权益合计	394,758,245.23	508,768,459.53

(二) 泰康养老保障管理产品——受托户

12 月资产负债表新准则

行次	科目名称	人民币(元)	
		年初数	期末数
1	货币资金:	68,262,173.82	31,826,748.85
2	其中: 现金	-	-
3	活期存款	68,262,173.82	31,826,748.85
4	其他货币资金	-	-
5	定期存款	-	-