

中金安心回报集合资产管理计划

2016 年第 3 季度资产管理报告

2016 年 9 月 30 日

集合计划管理人：中国国际金融股份有限公司

集合计划托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 26 日

§1 重要提示

本报告由中金安心回报集合资产管理计划（“本集合计划”）管理人中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）编制。

本集合计划托管人华夏银行股份有限公司于 2016 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告。

本集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

本报告内容由管理人负责解释。

§2 集合计划产品概况

集合计划全称:	中金安心回报集合资产管理计划
交易代码:	920011
集合计划运作方式:	非限定性、开放式
集合计划成立日:	2010 年 3 月 29 日
报告期末集合计划份额:	35,213,586.11 份
集合计划存续期限:	本集合计划不设固定存续期限
投资目标:	以集合计划资产保值增值为目标，力争控制组合最大损失额，获取管理期间的稳定收益。
投资策略:	本集合计划以股票、债券及货币市场投资为主要投资工具，以参与新股发行及增发认购为收益增强手段，灵活运用多种投资策略，追求委托资产的稳定收益。
业绩比较基准:	无

风险收益特征:	本集合计划的风险收益特征呈现为中等风险、收益稳定, 适合推广对象为风险承受能力适中、追求稳定回报的投资者或投资组合中稳定回报的配置部分。
集合计划管理人:	中国国际金融股份有限公司
集合计划托管人:	华夏银行股份有限公司

§3 主要财务指标和集合计划净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2016 年 7 月 1 日-2016 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	2,064,029.46
2. 本期利润	1,231,924.38
3. 加权平均集合计划份额本期利润	0.0452
4. 期末集合计划资产净值	50,640,227.49
5. 期末集合计划份额净值	1.4381

注: ①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)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损益。

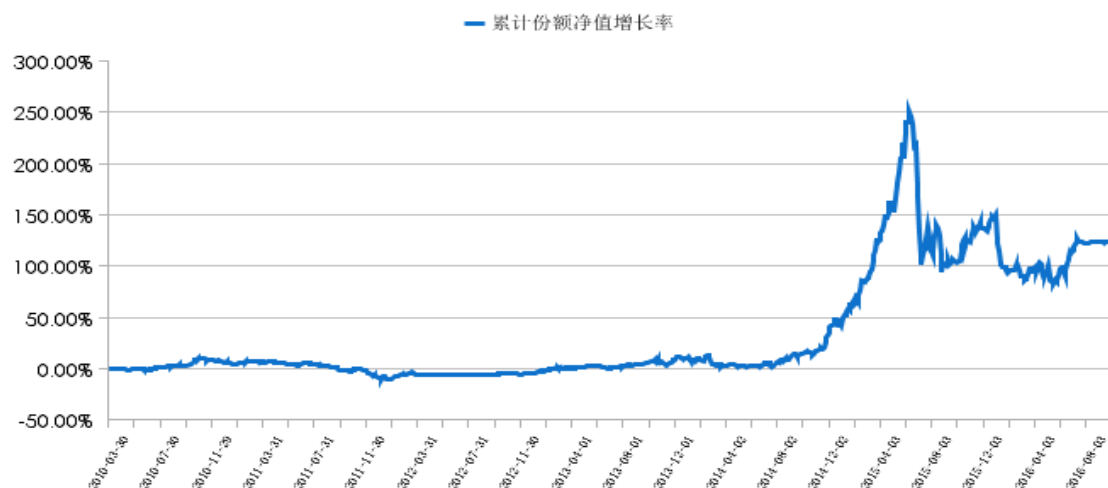
3.2 集合计划净值表现

3.2.1 本报告期集合计划份额净值增长率

阶段	净值增长率	净值增长率标准差
过去三个月	4.96%	0.53%

3.2.2 自集合计划成立以来集合计划累计净值增长率变动

中金安心回报集合资产管理计划累计份额净值增长率历史走势图
(2010 年 3 月 29 日至 2016 年 9 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 集合计划投资主办人简介

姓名	职务	任本集合计划 投资主办人期限		证券从 业年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
文尽远	投资 经理	2015-4-10	—	9 年	文尽远先生，中国人民大学会计学硕士。2008 年加入中金公司，从事研究分析工作，先后担任中金公司资产管理部农业研究员，轻工研究员，食品饮料研究员，电力和环保行业研究员，投资经理助理。现任中金股票策略、中金配置、中金股票精选、中金安心回报集合资产管理计划投资经理。
龚嘉斌	投资 经理	2016-2-18	-	6 年	龚嘉斌先生获清华大学经济管理学院金融硕士学位和清华大学物理学学士学位，现任中金公司资产管理部副总经理、FoF 投资经理兼 FoF 投资决策委员会成员。在此之前，龚嘉斌先生主要负责海外对冲

					基金母基金投资业务，在全球范围内进行策略配置和对冲基金遴选，对文艺复兴、保尔森基金、Brevan Howard、Citadel、Winton、景林资产等 600 多家知名对冲基金进行过尽职调查和策略研究，具有多年的策略配置和 FoF 投研经验。
--	--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

4.2.1 集合计划合规运作说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、其他相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产。

报告期内，本集合计划合法合规运作，投资管理符合相关法律法规、本集合计划说明书和合同的规定，不存在违法违规、未履行合同承诺或损害本集合计划份额持有人利益的情形。

4.2.2 集合计划风险管理报告

报告期内，中金公司资产管理部风险管理委员会负责独立开展本集合计划投资运作的风险管理，定期向公司管理层提供合规与风险管理报告。

报告期内，本集合计划管理人坚持规范运作、防范风险、保护投资者利益，严格执行中金公司内部控制与风险管理制度，致力于加强业务合规性的定期监控与检查，落实各项法律法规和管理制度，以使本集合计划合同得到严格履行。

报告期内，本集合计划管理人严格遵守有关法律法规和本集合计划投资指引的各项规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划份额持有人获取长期稳健收益，未出现风险事故或其他损害集合计划份额持有人利益的情形。

4.3 报告期内集合计划的投资策略和业绩表现说明

4.3.1 本集合计划业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，本集合计划份额净值为 1.4381 元，累计份额净值为 2.0611 元，本期净值增长率为 4.96%。

4.3.2 行情回顾及运作分析

中金安心回报集合资产管理计划成立于 2010 年 3 月，之前以权益类投资为主，力求为客户获取股市上涨带来的收益。但权益投资的波动性过高，特别是随着近年来经济结构性转型，预期股票长期回报率下行，权益投资相对风险日益增大。

为了更好的实现客户资产保值增值，自 2016 年 8 月以来，投资策略转型为资产配置策略，通过基本面分析和量化模型相结合，及时对市场的变化做出反应，在追求集合计划资产安全性的前提下，通过完全积极的运作在各类资产间进行动态配置，为投资者获取长期稳定的收益。

7 月份，组合重点布局的煤炭板块获得了较好的收益。自 8 月份投资策略转型以来，投资组合随着股票市场的变化适时对股票类资产的仓位进行调整，8 月初市场大幅反弹，投资组合逐渐增加权益类资产配置，力求获取市场上涨的部分收益，并于 8 月中下旬逐渐适当减仓，直至 9 月市场大幅回调、风险有所释放后，权益类资产仓位再次有小幅增加。

4.3.3 市场展望与投资策略

近期，A 股市场延续震荡整理的走势，目前波动率水平处于低位，交易活跃度和日内振幅均有所下降，往前看整体较为谨慎，仍将以区间震荡为主。债券市场在旺盛的配置需求下，利率或仍有一定下降空间，但收益率已处于历史低位，下行空间有限。进入四季度，我们将继续维持进退有度的仓位，用相对均衡的组合来应对市场的波动，积极发挥主动配置的作用，抓住资产轮动的机会。同时，进一步提高对风险的关注度，严控风险，减少回撤。

§5 托管人报告

中金安心回报集合资产管理计划托管人——华夏银行股份有限公司，根据《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》及其它有关法律文件，在集合资产管理计划运作过程中，严格遵守《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》及其他法律法规的规定，对中金安心回报集合资产管理计划 2016 年第 3 季度的投资运作进行了认真、独立的会计核算和投资监督，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害中金安心回报集合资产管理计划份额持有人利益的行为。

托管人认为，报告期内，计划管理人中国国际金融有限公司在中金安心回报集合资产管理计划的投资运作、计划资产净值的计算、计划费用列支等方面，能够遵守《证券公司客户资产管理业务管理办法》等有关法律法规的规定和《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》等有关法律文件的约定，未发现存在损害计划份额持有人利益的行为。

根据有关法律法规要求，托管人对计划管理人所编制的中金安心回报集合资产管理计划 2016 年第 3 季度资产管理报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容进行了认真、独立的会计核查，认为其真实、准确和完整。

华夏银行股份有限公司资产托管部
2016 年 10 月 26 日

§6 投资组合报告

6.1 报告期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占集合计划总资产比例
1	权益投资	13,422,638.99	20.41%
	其中：股票	13,422,638.99	20.41%
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	30,700,000.00	46.68%
6	银行存款和结算备付金合计	21,523,558.84	32.73%
7	其他资产	121,454.88	0.18%
8	合计	65,767,652.71	100.00%

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	137,944.00	0.27%
B	采矿业	193,773.01	0.38%
C	制造业	4,574,447.33	9.03%
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,136,790.60	2.24%
E	建筑业	181,299.90	0.36%
F	批发和零售业	1,911,038.13	3.77%
G	交通运输、仓储和邮政业	949,196.23	1.87%
H	住宿和餐饮业	23,078.00	0.05%
I	信息传输、软件和信息技术服务业	449,356.82	0.89%
J	金融业	2,522,601.75	4.98%
K	房地产业	910,657.70	1.80%
L	租赁和商务服务业	35,975.97	0.07%
M	科学研究和技术服务业	210,852.90	0.42%

N	水利、环境和公共设施管理业	50,723.84	0.10%
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	25,208.65	0.05%
R	文化、体育和娱乐业	104,408.16	0.21%
S	综合	5,286.00	0.01%
	合计	13,422,638.99	26.51%

6.3 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占集合计划资产净值比例
1	601318	中国平安	8,433	288,071.28	0.57%
2	601166	兴业银行	17,173	274,252.81	0.54%
3	600030	中信证券	15,210	245,185.20	0.48%
4	601288	农业银行	76,033	237,983.29	0.47%
5	600889	南京化纤	20,336	236,914.40	0.47%
6	601398	工商银行	46,750	207,102.50	0.41%
7	600015	华夏银行	18,174	182,648.70	0.36%
8	601818	光大银行	47,800	181,162.00	0.36%
9	600629	华建集团	8,753	174,359.76	0.34%
10	601377	兴业证券	22,961	173,585.16	0.34%

6.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占集合计划资产净值比例
1	国家债券	-	-
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	可转债	-	-
7	中期票据	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

6.5 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

。

6.6 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划报告期末未持有资产支持证券。

6.7 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本集合计划报告期末未持有权证。

6.8 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本集合计划报告期末未持有基金。

6.9 投资组合报告附注

6.9.1 报告期内集合计划投资前十名证券中的兴业证券（股票代码 601377）发行主体因违反证券法律法规，于 2016 年 7 月 9 日被证监会行政处罚。

6.9.2 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	90,209.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	31,245.48
5	应收参与款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
	合计	121,454.88

6.9.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

6.9.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

6.9.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§7 集合计划份额变动

单位：份

报告期期初集合计划份额总额	13,346,915.09
报告期间集合计划总参与份额	22,262,825.02
报告期间集合计划总退出份额	396,154.00
报告期期间集合计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	

报告期期末集合计划份额总额	35,213,586.11
---------------	---------------

§8 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，由于工作岗位调整，自2016年07月28日起，中金安心回报集合资产管理计划投资主办人员由文尽远先生变更为龚嘉斌先生。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 《中金安心回报集合资产管理计划说明书》
- 9.1.2 《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》
- 9.1.3 《中金安心回报集合资产管理计划托管协议》
- 9.1.4 《关于核准中国国际金融股份有限公司设立中金安心回报集合资产管理计划的批复》
- 9.1.5 管理人业务资格批件、营业执照

9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和/或集合计划托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到集合计划管理人、集合计划托管人的住所或集合计划管理人网站 <http://www.cicc.com.cn/AssetMgmt> 查阅备查文件或致电：800-810-8802（固话用户），（010）6505-0105（手机用户）查询。

中国国际金融股份有限公司
2016 年 10 月 26 日