

国金鑫安保本混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

2017-03-31

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2017-04-22

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金产品概况](#)

[基金基本情况](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[本报告期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](#)

[自基金合同生效以来基金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](#)

[其他指标](#)

[管理人报告](#)

[基金经理（或基金经理小组）简介](#)

[管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明](#)

[公平交易专项说明](#)

[公平交易制度的执行情况](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[报告期内基金的投资策略和业绩表现说明](#)

[报告期内基金的投资策略和运作分析](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#)

[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](#)

[投资组合报告](#)

[报告期末基金资产组合情况](#)

[报告期末按行业分类的股票投资组合](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细](#)

[报告期末按债券品种分类的债券投资组合](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细](#)

[报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明](#)

[报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细](#)

[本基金投资股指期货的投资政策](#)

[报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明](#)

[本期国债期货投资政策](#)

[报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细](#)

[本期国债期货投资评价](#)

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

其他资产构成

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

影响投资者决策的其他重要信息

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

备查文件目录

存放地点

查阅方式

重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 3 月 31 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

国金鑫安保本

场内简称

基金主代码

000749

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2014-08-27

报告期末基金份额总额

89,031,044.22

投资目标

本基金在保证客户本金的基础上，力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

投资策略

本基金通过固定比例投资组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）策略和时间不变性投资组合保险（TIPP，Time Invariant Portfolio Protection）策略，在保本周期中，对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整，确保投资者的投资本金的安全性。同时，本基金通过积极稳健的收益资产投资策略，竭力为基金资产获取更高的增值回报。

本基金的投资策略主要由五部分组成：资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略。

业绩比较基准

一年期银行定期存款税后收益率

风险收益特征

本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。

基金管理人

国金基金管理有限公司

基金托管人

中国光大银行股份有限公司

基金保证人

瀚华担保股份有限公司

注：无

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标

报告期（2017-01-01 至 2017-03-31）

本期已实现收益

549,301.66

本期利润

515,347.27

加权平均基金份额本期利润

0.0057

期末基金资产净值

89,460,957.48

期末基金份额净值

1.005

注：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。

2、所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。

□

基金净值表现

本报告期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

净值增长率①

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

0.60%

0.03%

0.36%

0.00%

0.24%

0.03%

注：本基金的业绩比较基准为：一年期定期存款收益率（税后）

自基金合同生效以来基金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

注：图示日期为 2014 年 8 月 27 日至 2017 年 3 月 31 日。

其他指标

单位：人民币元

其他指标

报告期（2017-01-01 至 2017-03-31）

其他指标

报告期（2017-03-31）

注：注：无

基金经理（或基金经理小组）简介

姓名

职务

任本基金的基金经理期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

宫雪

本基金基金经理，国金 300、国金上证 50、国金鑫新灵活配置（LOF）基金经理，量化投资事业三部总经理

2014-08-27

-

9

宫雪女士，中国科学院博士。2008 年 7 月至 2011 年 12 月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012 年 2 月至今在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分

析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理，自 2016 年 4 月起任量化投资事业三部总经理。

滕祖光

本基金基金经理，国金国鑫发起基金经理

2015-08-18

-

12

滕祖光先生，中央财经大学硕士。2003 年至 2009 年先后历任中国工商银行深圳分行国际业务员、中大期货经纪有限公司期货交易员、和讯信息科技有限公司高级编辑、国投信托有限公司证券交易员。2009 年 11 月加入国金基金管理有限公司，历任基金交易部高级交易员、投资研究部基金经理、固定收益投资部基金经理；自 2017 年 3 月起任投资管理部基金经理。

李安心

本基金基金经理，国金国鑫发起基金经理

2016-10-17

-

13

李安心先生，复旦大学硕士。2004 年 1 月至 2005 年 5 月在金元证券有限责任公司任研究员；2005 年 6 月至 2012 年 8 月在中邮创业基金管理有限公司任研究员、基金经理；2012 年 9 月至 2013 年 1 月在国金基金管理有限公司任特定资产管理部副总经理；2013 年 1 月至 2016 年 8 月在北京千石创富资本管理有限公司历任特定资产管理部投资副总监、乾石投资工作室投资副总监、证券投资部投资副总监。2016 年 8 月再次加入国金基金管理有限公司，历任权益投资事业部基金经理；自 2017 年 3 月起任投资管理部基金经理。

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（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。

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和其他有关法律法规的规定，以及《国金鑫安保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，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交易，未出现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% 的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期，本基金严格遵守基金合同，在保本周期中，对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整，确保投资者的投资本金的安全性。同时，本基金通过积极稳健的收益资产投资策略，竭力为基金资产获取更高的增值回报。

报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为 0.60%，同期业绩比较基准收益率为 0.36%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

序号

项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

权益类投资

93,687.00

0.10

其中：股票

93,687.00

0.10

2

固定收益投资

29,557,631.40

32.54

其中：债券

29,557,631.40

32.54

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

59,976,164.92

66.03

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

350,981.52

0.39

7

其他资产

848,947.93

0.93

8

合计

90,827,412.77

100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

-

-

B

采矿业

-

-

C

制造业

-

-

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

-

-

G

交通运输、仓储和邮政业

93,687.00

0.10

H

住宿和餐饮业

-

-

I

信息传输、软件和信息技术服务业

-

-

J

金融业

-

-

K

房地产业

-

-

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

93,687.00

0.10

注：注：以上行业分类以 2017 年 3 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

报告期末按公允价值占基金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）

占基金资产净值比例（%）

1

000916

华北高速

18,700

93,687.00

0.10

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）

占基金资产净值比例（%）

1

国家债券

8,591,120.00

9.60

2

央行票据

-

-

3

金融债券
2,071,000.00
2.31
其中：政策性金融债
2,071,000.00
2.31
4

企业债券
15,631,011.40
17.47

5
企业短期融资券

-
-

6
中期票据

-
-

7
可转债（可交换债）

3,264,500.00
3.65

8
同业存单

-
-

9
其他

-
-

10
合计
29,557,631.40

33.04

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）

占基金资产净值比例（%）

1

112079

12 长安债

70,000
 7,000,000.00
 7.82
 2
 112124
 11 徐工 02
 56,260
 5,637,814.60
 6.30
 3
 019546
 16 国债 18
 50,000
 4,994,000.00
 5.58
 4
 010303
 03 国债(3)
 36,000
 3,597,120.00
 4.02
 5
 110035
 白云转债
 25,000
 3,216,500.00
 3.60

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：注：本基金本报告期末未持有贵金属。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险说明

公允价值变动总额合计(元)

-

股指期货投资本期收益(元)

-

股指期货投资本期公允价值变动(元)

-

注：注：本基金本报告期末未持有股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

报告期，本基金未参与股指期货的投资。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

报告期，本基金未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益（元）

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

注：注：本基金本报告期末未参与国债期货投资。

本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体，本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

其他资产构成

单位：人民币元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

19,593.30
2
应收证券清算款
2,503.88
3
应收股利
-
4
应收利息
767,011.88
5
应收申购款
14.00
6
其他应收款
-
7
待摊费用
59,824.87
8
其他
-
9
合计
848,947.93

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：人民币元

序号
债券代码
债券名称
公允价值（元）
占基金资产净值比例（%）

1
110035
白云转债
3,216,500.00

3.60

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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（元）
占基金资产净值比例（%）

流通受限情况说明

1

000916

华北高速

93,687.00

0.10

临时停牌

投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

开放式基金份额变动

单位：份

项目

数值

报告期期初基金份额总额

93,120,369.33

报告期期间基金总申购份额

437,227.34

减：报告期期间基金总赎回份额

4,526,552.45

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）

报告期期末基金份额总额

89,031,044.22

注：注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目

基金份额

报告期期初管理人持有的本基金份额

报告期期间买入/申购总份额

报告期期间卖出/赎回总份额

报告期期末管理人持有的本基金份额

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)

-

注：本报告期，基金管理人未持有基金份额。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号

交易方式

交易日期

交易份额（份）

交易金额（元）

适用费率

合计

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

报告期末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

-%

-%

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

-%

-%

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别

报告期内持有基金份额变化情况

报告期末持有基金情况

序号

持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间

期初份额

申购份额

赎回份额

持有份额

份额占比

机构

-

-

-

-

-

-

-

个人

-
-
-
-
-
-
-
-

产品特有风险

-

注：本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站进行了如下信息披露：

1、2017 年 1 月 3 日披露了《国金基金管理有限公司 2016 年 12 月 31 日旗下基金净值公告》

；

2、2017 年 1 月 4 日披露了《国金基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》；

3、2017 年 1 月 10 日披露了《国金基金管理有限公司关于增加上海华信证券有限责任公司和贵州华阳众惠基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》；

4、2017 年 1 月 21 日披露了《国金鑫安保本混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告》

；

5、2017 年 1 月 25 日披露了《关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》；

6、2017 年 2 月 13 日披露了《国金基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职责的公告》

；

7、2017 年 3 月 28 日披露了《国金鑫安保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告》《国金鑫安保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要》。

本报告期内，基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值。

备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金鑫安保本混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金鑫安保本混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金鑫安保本混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

存放地点

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com