

国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

[2015] 第一季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:宁波银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

§1 要点提示
基金管理人的董事及高级管理人员不存在被限制人身自由的情况,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别责任和连带责任。
基金合同生效后,基金管理人将根据有关法律法规的规定在招募说明书、定期报告和临时公告中披露基金的资产配置情况,但不保证一定定期披露。
基金管理公司对旗下所有基金承担连带责任。投资者在作出投资决策前应仔细阅读招募说明。
基金合同自2013年1月31日起生效。

§2 基金产品概况

基金简称 国泰民益灵活配置混合

场内简称 国泰民益

基金代码 160220

交易代码 160220

基金运作方式 上市契约型开放式

基金合同生效日 2013年1月31日

报告期末基金份额总额 3,402,964,600.24份

投资目标 前瞻地把握中国经济市场趋势,证券投资、银行间市场的收益率,在控制下行风险的前提下为投资人争取取向回报。

投资策略

1. 大类资产配置:本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家政策和股市政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,并以此评估未来一段时期内股票、债券对市场的收益,主动调整资产配置比例,以达到降低整体风险、提高整体收益的目的。

2. 股票投资策略:

本基金将股票作为主要投资品种,通过深入研究上市公司的基本面,运用基本面分析方法,结合行业估值水平,深入挖掘价值低估的股票,结合动态估值水平判断股票的投资价值,充分考虑中签率、集中度等因素,有效选择投资品种,以获取较好收益。

3. 固定收益品种投资策略:

本基金将固定收益品种作为主要投资品种来配置;久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。

4. 货币类投资策略:

本基金将货币类资产优先考虑股债平衡,通过资产配置,实现资产的保值增值。

5. 投资策略:

本基金将为基金管理人投资工具,其具体操作为利用本基金的资产净值,在权重投资于股票的基础上,根据其净值变化情况,在使用量化模型分析其操作的精准度后,立足于无风险收益,尽力减少波动风险,力求创造超额收益。

业绩比较基准 三年期定期存款利率(税后)×10% + 资本利得税后收益(税后)×90%
自2015年3月23日起本基金业绩比较基准由原五期定期存款利率(税后)×12%变更为“三年期定期存款利率(税后)×12%”。

风险收益特征 本基金为混合型基金,其风险特征、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

基金管理人 国泰基金管理有限公司

基金托管人 宁波银行股份有限公司

§3 主要财务指标

报告期:2015年1月1日至2015年3月31日

单位:人民币元

主要财务指标 2015年1月1日至2015年3月31日

1.本期已实现收益 307,366,540.27

2.本期利润 301,272,722.26

3.期初至报告期利润累计增长百分比 6,030.07%

4.期末基金份额净值 4,163,264,666.17

5.期末基金资产净值 1,102

(注:1)本基金在报告期内因投资人申购、赎回或转换,投资人不能立即变现的费用,本报告期为本期初至报告期末止,本期末的资产净值以期初的资产净值加减。

(2)本基金在报告期内不含有认购或交易基金的各类型基金,且期间实际收益水平等于所列数字。

3.21 本期基金份额变动情况

3.22 本期基金份额持有人结构变动

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 7.10% 0.13% 1.42% 0.02% 5.57% 0.11%

3.23 本基金在报告期内基金资产组合变动情况

3.24 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.25 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.26 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.27 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.28 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.29 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.30 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.31 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.32 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.33 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.34 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.35 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.36 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.37 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.38 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.39 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.40 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.41 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.42 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.43 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.44 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.45 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.46 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.47 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.48 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.49 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.50 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.51 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.52 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.53 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.54 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.55 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.56 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.57 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.58 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.59 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.60 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.61 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.62 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.63 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.64 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.65 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.66 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.67 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.68 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.69 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.70 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.71 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.72 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.73 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.74 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月31日) (%)

3.75 本基金在报告期内基金资产组合变动情况的百分比如下表所示:

(注:3月20日-3月