

中银颐利灵活配置混合型证券投资基金

[2017]第一季度报告

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明本基金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。

基金托管人声明本基金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。

基金销售机构承認本基金的报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表基金未来的业绩表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 中银颐利混合

基金主代码 002614

基金运作方式 灵活的开放式

基金合同生效日 2016年09月01日

报告期末基金资产总额 854,154,526.09元

投资目标 本基金在严格控制风险的前提下，通过科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及个股精选策略，力争在风险调整后收益方面超越业绩比较基准，实现基金资产的保值增值。

投资策略 本基金在严格控制风险的前提下，通过科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及个股精选策略，力争在风险调整后收益方面超越业绩比较基准，实现基金资产的保值增值。

业绩比较基准 业绩比较基准为业绩基准，即：沪深300指数收益率×60%+中债总收益指数×40%。

风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币基金和货币市场基金，但低于股票基金，属于中等风险水平的基金。

基金管理人 中银基金管理有限公司

基金托管人 招商银行股份有限公司

下属基金份额的基金简称 中银颐利混合C

基金主代码 002614

基金运作方式 灵活的开放式

基金合同生效日 2016年09月01日

报告期末基金资产总额 101,641,032.61元

1.3 主要财务指标

报告期:2017年1月1日至2017年3月31日

单位:人民币元

主要财务指标 中银颐利混合 中银颐利混合C

1.本期已实现收益 6,632,563.09 1,081,665.06

2.本期利润 9,795,572.24 1,543,124.36

3.期末可供分配利润 6,010.60 917.01

4.期末基金资产净值 749,431,366.89 103,804,477.42

5.期末基金份额净值 1.022

6.期末可供分配基金份额净值 0.000

7.期末基金资产总值 752,143,730.06元

8.期末基金份额净值 101,641,032.61元

9.3 主要财务指标和基金净值表现

报告期:2017年1月1日至2017年3月31日

单位:人民币元

主要财务指标 中银颐利混合C

1.本期已实现收益 229,610,986.12 3254

2.本期利润 10,941,986.79 1.27

3.期末可供分配利润 859,354,080.00 100.00

4.期末基金资产净值 859,354,080.00元

5.期末基金份额净值 1.000元

6.期末可供分配基金份额净值 0.000元

7.期末基金资产总值 919,796,452.00元

8.期末基金份额净值 1.000元

9.4 报告期内基金利润分配情况

报告期:2017年1月1日至2017年3月31日

单位:人民币元

序号 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 制造业 4,018,000.00 0.47

3 建筑业 28,916,096.54 3.39

4 电力、热力、燃气及水的生产和供应业 8,390,100.00 0.98

5 交通运输、仓储和邮政业 5,597,089.00 0.67

6 住宿和餐饮业 13,509,346.00 1.58

7 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

8 金融业 63,726,166.40 7.48

9 房地产业 - -

10 其他服务业 - -

11 合计 327,194,507.40 1.40%

9.5 报告期内履行持续信息披露义务的期间

报告期:2017年1月1日至2017年3月31日

单位:人民币元

序号 代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 001306 工商银行 2,600,000.00 1.42

2 000001 平安银行 1,099,026.00 1.08

3 000003 华东医药 92,000.00 0.01

4 000008 中国银行 620,000.00 0.08

5 000142 宁波银行 440,000.00 0.06

6 001130 中国平安 210,000.00 0.01

7 000727 乐普药业 2,200,000.00 0.09

8 000009 中国银行 600,000.00 0.08

9 001108 中国银行 300,000.00 0.07

10 001109 中国银行 300,000.00 0.06

11 合计 716,976,015.54 7,000,010.34

9.6 报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期:2017年1月1日至2017年3月31日

单位:人民币元

序号 代码 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

1 0.10% 0.11% 2.19% 0.32% -0.44% -0.21%

2 0.10% 0.11% 2.13% 0.26% -0.44% -0.21%

3 0.08% 0.09% 1.90% 0.21% -0.44% -0.21%

4 0.08% 0.09% 1.89% 0.21% -0.44% -0.21%

5 0.07% 0.08% 1.88% 0.21% -0.44% -0.21%

6 0.07% 0.08% 1.87% 0.21% -0.44% -0.21%

7 0.06% 0.07% 1.86% 0.21% -0.44% -0.21%

8 0.06% 0.07% 1.85% 0.21% -0.44% -0.21%

9 0.05% 0.06% 1.84% 0.21% -0.44% -0.21%

10 0.05% 0.06% 1.83% 0.21% -0.44% -0.21%

11 0.04% 0.05% 1.82% 0.21% -0.44% -0.21%

12 0.04% 0.05% 1.81% 0.21% -0.44% -0.21%

13 0.03% 0.04% 1.80% 0.21% -0.44% -0.21%

14 0.03% 0.04% 1.79% 0.21% -0.44% -0.21%

15 0.02% 0.03% 1.78% 0.21% -0.44% -0.21%

16 0.02% 0.03% 1.77% 0.21% -0.44% -0.21%

17 0.01% 0.02% 1.76% 0.21% -0.44% -0.21%

18 0.01% 0.02% 1.75% 0.21% -0.44% -0.21%

19 0.00% 0.01% 1.74% 0.21% -0.44% -0.21%

20 0.00% 0.01% 1.73% 0.21% -0.44% -0.21%

21 0.00% 0.01% 1.72% 0.21% -0.44% -0.21%

22 0.00% 0.01% 1.71% 0.21% -0.44% -0.21%

23 0.00% 0.01% 1.70% 0.21% -0.44% -0.21%

24 0.00% 0.01% 1.69% 0.21% -0.44% -0.21%

25 0.00% 0.01% 1.68% 0.21% -0.44% -0.21%

26 0.00% 0.01% 1.67% 0.21% -0.44% -0.21%

27 0.00% 0.01% 1.66% 0.21% -0.44% -0.21%

28 0.00% 0.01% 1.65% 0.21% -0.44% -0.21%

29 0.00% 0.01% 1.64% 0.21% -0.44% -0.21%

30 0.00% 0.01% 1.63% 0.21% -0.44% -0.21%

31 0.00% 0.01% 1.62% 0.21% -0.44% -0.21%

32 0.00% 0.01% 1.61% 0.21% -0.44% -0.21%

33 0.00% 0.01% 1.60% 0.21% -0.44% -0.21%

34 0.00% 0.01% 1.59% 0.21% -0.44% -0.21%

35 0.00% 0.01% 1.58% 0.21% -0.44% -0.21%

36 0.00% 0.01% 1.57% 0.21% -0.44% -0.21%

37 0.00% 0.01% 1.56% 0.21% -0.44% -0.21%

38 0.00% 0.01% 1.55% 0.21% -0.44% -0.21%

39 0.00% 0.01% 1.54% 0.21% -0.44% -0.21%

40 0.00% 0.01% 1.53% 0.21% -0.44% -0.21%

41 0.00% 0.01% 1.52% 0.21% -0.44% -0.21%

42 0.00% 0.01% 1.51% 0.21% -0.44% -0.21%

43 0.00% 0.01% 1.50% 0.21% -0.44% -0.21%

44 0.00% 0.01% 1.49% 0.21% -0.44% -0.21%

45 0.00% 0.01% 1.48% 0.21% -0.44% -0.21%

46 0.00% 0.01% 1.47% 0.21% -0.44% -0.21%

47 0.00% 0.01% 1.46% 0.21% -0.44% -0.21%

48 0.00% 0.01% 1.45% 0.21% -0.44% -0.21%

49 0.00% 0.01% 1.44% 0.21% -0.44% -0.21%

50 0.00% 0.01% 1.43% 0.21% -0.44% -0.21%

51 0.00% 0.01% 1.42% 0.21% -0.44% -0.21%

52 0.00% 0.01% 1.41% 0.21% -0.44% -0.21%

53 0.00% 0.01% 1.40% 0.21% -0.44% -0.21%