

国泰民利保本混合型证券投资基金

[2017] 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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2017年4月22日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及监事保证本基金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和连带的法律责任。
本基金经中国证监会于2014年1月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金合同生效后，基金管理人承诺不以定期报告的形式向基金份额持有人报告基金的招募说明书。
本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰民利保本混合
基金代码	002468
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月1日
报告期末基金份额总额	2,999,032,800.04份
投资目标	本基金力争在严控风险的前提下，为投资人提供投资金额安全的保证，在此基础上力争获得一定的资本增值。
投资策略	本基金采用恒定比例保险策略（CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance）策略动态调整资产配置，在股票、债券及货币市场工具等投资品种间的配置比例，以实现保本的目地。
业绩比较基准	三年定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合基金，属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金保证人	重庆三峡担保集团股份有限公司

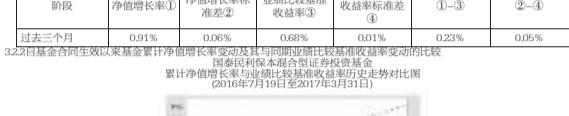
§ 3 主要财务指标

报告期(2017年1月1日-2017年3月31日) 单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日) 1.本期已实现收益 15,562,615.40 2.本期利润 20,618,334.20 3.加权平均基金份额本期利润 0.0009 4.期末基金份额净值 2,968,139,464.09 5.期末基金资产净值 1,002

注1:本基金的任何收益分配均不包括持有人认购或申购基金时产生的费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 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



注1:本基金的任何收益分配均不包括持有人认购或申购基金时产生的费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.3 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 0.01% 0.00% 0.01% 0.23% 0.00%

3.2.2 本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对比图

报告期(2010年1月10日至2017年3月31日) 单位：人民币元

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 合力泰 1,126,173 21,937,850.04 0.74

2 东宝国际 300148 916,212 18,589,941.48 0.63

3 东晶电子 462,100 15,823,500.00 0.53

4 中航国际 964,901 15,409,469.97 0.52

5 中国宝安 276,800 11,678,392.00 0.39

6 五洲传播 253,000 10,879,000.00 0.37

7 中国船舶 466,062 10,829,686.98 0.37

8 东信和平 1,621,228 7,307,790.00 0.25

9 中国南玻 A 299,300 6,404,080.00 0.19

10 顺络电子 260,000 4,049,800.00 0.14

6.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 105,032,718.66 355

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 15,409,469.97 0.52

F 批发和零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 餐饮业和住宿业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 7,307,790.00 0.25

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、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 - 18,589,941.48 0.63

S 综合 - -

合计 146,396,849.27 4.06

6.5 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 002217 合力泰 1,126,173 21,937,850.04 0.74

2 300148 东宝国际 300148 916,212 18,589,941.48 0.63

3 002016 东晶电子 462,100 15,823,500.00 0.53

4 002210 中航国际 964,901 15,409,469.97 0.52

5 000968 中国宝安 276,800 11,678,392.00 0.39

6 000895 五洲传播 253,000 10,879,000.00 0.37

7 600006 中国船舶 466,062 10,829,686.98 0.37

8 601328 东信和平 1,621,228 7,307,790.00 0.25

9 000197 中国南玻 A 299,300 6,404,080.00 0.19

10 002520 顺络电子 260,000 4,049,800.00 0.14

6.6 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大债券投资明细

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 国家债券 134,919,000.00 4.56

2 央行票据 - -

3 金融债券 - -

4 中央企业债 - -

5 企业短期融资券 630,662,000.00 21.32

6 企业中期票据 1,130,628,000.00 38.63

7 可转债(可交换) 12,077,000.00 0.41

8 国开行存单 190,470,000.00 6.71

9 其他 - -

10 合计 2,115,756,000.00 71.52

6.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十五大债券投资明细

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 160498320906 2,000,000 199,980,000.00 6.70

2 011608306 1,600,000 150,165,000.00 5.08

3 011608421 160707 1,600,000 150,165,000.00 5.08

4 01160839 16国开11 1,360,000 134,919,000.00 4.56

5 01160841 16国开1 1,000,000 100,040,000.00 3.38

6.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十五大权证投资明细

序号 代码 名称 金额(元)

1 0464737 有存保证金 46,047,077

2 0464738 收应收款融资款 999,222,233

3 0464739 收应利息 -

4 0464740 收应利滚利 25,162,991.22

5 0464741 收购回购款 2,013,658

6 其他应收款项 -

7 短期融资券 -

8 其他 -

9 合计 26,210,075.00

6.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

6.10 报告期末持有的公允价值变动损益的说明

本基金报告期末无公允价值变动损益。

6.11 报告期末持有的其他公允价值变动损益的说明

本基金报告期末未持有其他公允价值变动损益。

6.12 报告期末持有的其他资产的说明

本基金报告期末未持有其他资产。

6.13 报告期末持有的其他负债的说明

本基金报告期末未持有其他负债。

6.14 报告期末持有的其他资产和负债的说明

本基金报告期末未持有其他资产和负债。

6.15 报告期末持有的其他负债的说明

本基金报告期末未持有其他负债。

6.16 报告期末持有的其他资产的说明

本基金报告期末未持有其他资产。

6.17 报告期末持有的其他负债的说明

本基金报告期末未持有其他负债。

6.18 报告期末持有的其他资产和负债的说明

本基金报告期末未持有其他资产和负债。

6.19 报告期末持有的其他负债的说明

本基金报告期末未持有其他负债。

6.20 报告期末持有的其他资产和负债的说明

本基金报告期末未持有其他资产和负债。

6.21 报告期末持有的其他负债的说明

本基金报告期末未持有其他负债。

6.22 报告期末持有的其他资产和负债的说明

本基金报告期末未持有其他资产和负债。

6.23 报告期末持有的其他负债的说明

本基金报告期末未持有其他负债。

6.24 报告期末持有的其他资产和负债的说明

本基金报告期末未持有其他资产和负债。

6.25 报告期末持有的其他负债的说明</