

财通可持续发展主题混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

基金管理人:财通基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

81 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。 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月18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、误导性陈述或重大遗漏。

82 基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 场内简称, 基金代码, etc.) and Value (财通可持续发展, 000017, etc.)

83 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: Item (本期已实现收益, 本期利润, etc.) and Value (4,712,670.18, 9,407,164.27, etc.)

Table with 4 columns: Stage (过去三个月), Net Value Growth Rate (8.47%), etc.

注:(1)上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; (2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)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收益。

3.2.1 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)上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;

3.2.2 自基金合同生效以来本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的比较 注:(1)上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;

Table with 5 columns: Name, Position, Start Date, End Date, Description (基金经理: 曹晓红, 2015年7月13日, etc.)

注:(1)基金合同生效日为2013年3月27日; (2)根据《基金合同》规定:本基金投资于股票资产占基金资产60%-95%;投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规中国证监会允许基金投资的其他证券品种的资产占基金资产5%-40%;

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易的执行情况 本基金管理人以价值投资理念,致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系,营造公平交易的执行环境。

4.3.2 异常交易的专项说明 2017年一季度,市场基本延续了2016年四季度的风格,市场风险偏好有所上升,偏好确定性较高、估值较低的板块和个股中的龙头公司,在这种环境中我们分散了投资的板块,不仅限于某一行业或某一种风格,整体配置重自上而下板块的配置和自下而上的个股选择。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2017年一季度,市场基本延续了2016年四季度的风格,市场风险偏好有所上升,偏好确定性较高、估值较低的板块和个股中的龙头公司,在这种环境中我们分散了投资的板块,不仅限于某一行业或某一种风格,整体配置重自上而下板块的配置和自下而上的个股选择。

4.5 报告期内基金的投资表现 2017年一季度,本基金净值增长率为8.47%,业绩比较基准增长率3.58%,跑赢业绩比较基准4.89%。 4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 报告期内,本基金未有连续20个工作日基金份额持有人人数不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

4.7 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 2017年,我们认为经济和政策的博弈会更加激烈。上半年在降杠杆、化解风险的背景下,货币政策和流动性大幅宽松的概率不大;而由于中经济工作会议对于经济增长的定调,意味着短期稳增长的重要性有所下降,叠加压力调控的影响,经济可能在二、三季度存在压力,为了对冲经济下滑的影响,预计基建投资仍然是不可不少的,并且在降杠杆获得一定成效之后,流动性和货币政策仍有可能重新回到中性。因此,2017年的宏观和货币政策

味着全年市场难有较大起色,可能只存在阶段性和局部性的投资机会。 短期来看,我们认为经历了第一季度的上涨之后,未来市场可能延续震荡的趋势,难有持续性的大行情,未来的投资机会还是会主要集中在新能源、电子、消费、建筑一带一路等领域,可以重点关注业绩未来能够持续回升、估值合理、前期涨幅适中的标的。此外,雄安新区直接受益的品种如果未来回归到合理估值水平也值得重点关注。

Table with 4 columns: No., Item, Amount (元), Proportion (%) (序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: Code, Industry, Amount (元), Proportion (%) (代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: No., Stock Name, Quantity, Fair Value (元), Proportion (%) (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(%)

5.3 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组合明细

Table with 4 columns: No., Stock Name, Quantity, Fair Value (元), Proportion (%) (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(%)

5.4 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组合明细

Table with 4 columns: No., Bond Name, Quantity, Fair Value (元), Proportion (%) (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(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合明细

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

中海安鑫宝1号保本混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

基金管理人:中海基金管理有限公司 基金托管人:平安银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

81 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。

82 基金产品概况 基金名称:中海安鑫宝1号保本混合 基金代码:001155 交易代码:001155 基金运作方式:契约开放式 基金合同生效日:2015年4月3日

投资目标 通过采用保本投资策略,在保证本金安全的前提下,力争在报告期内实现基金资产的稳健增值。

投资策略 本基金以CPPI策略为进行资产配置和投资组合管理,通过CPPI策略动态调整固定收益资产与风险资产的投资比例,以确保本基金在一段时期内以后其资产不低于事先设定的某一目标价值,从而实现对基金资产的保本前提获取组合中的超额收益。

5.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 本基金本报告期末持有通过沪港通机制投资的港股。

5.3 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组合明细

Table with 4 columns: No., Stock Name, Quantity, Fair Value (元), Proportion (%) (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(%)

5.4 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组合明细

Table with 4 columns: No., Bond Name, Quantity, Fair Value (元), Proportion (%) (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(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合明细

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: No., Name, Amount (元), Proportion (%) (序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

83 主要财务指标和基金净值表现 注:(1)上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;

84 管理人报告 4.1 基金业绩(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

4.2 基金管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 2017年,我们认为经济和政策的博弈会更加激烈。上半年在降杠杆、化解风险的背景下,货币政策和流动性大幅宽松的概率不大;而由于中经济工作会议对于经济增长的定调,意味着短期稳增长的重要性有所下降,叠加压力调控的影响,经济可能在二、三季度存在压力,为了对冲经济下滑的影响,预计基建投资仍然是不可不少的,并且在降杠杆获得一定成效之后,流动性和货币政策仍有可能重新回到中性。因此,2017年的宏观和货币政策

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易的执行情况 根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节入手,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确定义。

4.3.2 异常交易的专项说明 2017年一季度,市场基本延续了2016年四季度的风格,市场风险偏好有所上升,偏好确定性较高、估值较低的板块和个股中的龙头公司,在这种环境中我们分散了投资的板块,不仅限于某一行业或某一种风格,整体配置重自上而下板块的配置和自下而上的个股选择。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2017年一季度,市场基本延续了2016年四季度的风格,市场风险偏好有所上升,偏好确定性较高、估值较低的板块和个股中的龙头公司,在这种环境中我们分散了投资的板块,不仅限于某一行业或某一种风格,整体配置重自上而下板块的配置和自下而上的个股选择。

4.5 报告期内基金的投资表现 2017年一季度,本基金净值增长率为0.79%,业绩比较基准增长率-0.15%,跑赢业绩比较基准0.94%。 4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 报告期内,本基金未有连续20个工作日基金份额持有人人数不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

4.7 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 2017年,我们认为经济和政策的博弈会更加激烈。上半年在降杠杆、化解风险的背景下,货币政策和流动性大幅宽松的概率不大;而由于中经济工作会议对于经济增长的定调,意味着短期稳增长的重要性有所下降,叠加压力调控的影响,经济可能在二、三季度存在压力,为了对冲经济下滑的影响,预计基建投资仍然是不可不少的,并且在降杠杆获得一定成效之后,流动性和货币政策仍有可能重新回到中性。因此,2017年的宏观和货币政策

4.8 报告期内基金的投资策略和运作分析 2017年一季度,市场基本延续了2016年四季度的风格,市场风险偏好有所上升,偏好确定性较高、估值较低的板块和个股中的龙头公司,在这种环境中我们分散了投资的板块,不仅限于某一行业或某一种风格,整体配置重自上而下板块的配置和自下而上的个股选择。

4.9 报告期内基金的投资表现 2017年一季度,本基金净值增长率为0.79%,业绩比较基准增长率-0.15%,跑赢业绩比较基准0.94%。 4.10 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 报告期内,本基金未有连续20个工作日基金份额持有人人数不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

4.11 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 2017年,我们认为经济和政策的博弈会更加激烈。上半年在降杠杆、化解风险的背景下,货币政策和流动性大幅宽松的概率不大;而由于中经济工作会议对于经济增长的定调,意味着短期稳增长的重要性有所下降,叠加压力调控的影响,经济可能在二、三季度存在压力,为了对冲经济下滑的影响,预计基建投资仍然是不可不少的,并且在降杠杆获得一定成效之后,流动性和货币政策仍有可能重新回到中性。因此,2017年的宏观和货币政策

4.12 公平交易专项说明 4.12.1 公平交易的执行情况 根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节入手,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确定义。

4.12.2 异常交易的专项说明 2017年一季度,市场基本延续了2016年四季度的风格,市场风险偏好有所上升,偏好确定性较高、估值较低的板块和个股中的龙头公司,在这种环境中我们分散了投资的板块,不仅限于某一行业或某一种风格,整体配置重自上而下板块的配置和自下而上的个股选择。

4.13 报告期内基金的投资策略和运作分析 2017年一季度,市场基本延续了2016年四季度的风格,市场风险偏好有所上升,偏好确定性较高、估值较低的板块和个股中的龙头公司,在这种环境中我们分散了投资的板块,不仅限于某一行业或某一种风格,整体配置重自上而下板块的配置和自下而上的个股选择。

4.14 报告期内基金的投资表现 2017年一季度,本基金净值增长率为0.79%,业绩比较基准增长率-0.15%,跑赢业绩比较基准0.94%。 4.15 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 报告期内,本基金未有连续20个工作日基金份额持有人人数不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

4.16 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 2017年,我们认为经济和政策的博弈会更加激烈。上半年在降杠杆、化解风险的背景下,货币政策和流动性大幅宽松的概率不大;而由于中经济工作会议对于经济增长的定调,意味着短期稳增长的重要性有所下降,叠加压力调控的影响,经济可能在二、三季度存在压力,为了对冲经济下滑的影响,预计基建投资仍然是不可不少的,并且在降杠杆获得一定成效之后,流动性和货币政策仍有可能重新回到中性。因此,2017年的宏观和货币政策

4.17 公平交易专项说明 4.17.1 公平交易的执行情况 根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节入手,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确定义。

4.17.2 异常交易的专项说明 2017年一季度,市场基本延续了2016年四季度的风格,市场风险偏好有所上升,偏好确定性较高、估值较低的板块和个股中的龙头公司,在这种环境中我们分散了投资的板块,不仅限于某一行业或某一种风格,整体配置重自上而下板块的配置和自下而上的个股选择。