

2016 4

2016 12 31

:

:

: 2017 1 21

	<p>3、 1 上 下 、 、 与 与 。 2 下 上 上 、 下 。 4、 下 与 、 上 。</p>
	<p>三 ()+ 1.5%</p>
	<p>。</p>

3

3.1

	2016 10 1	2016 12 31
1.		1,365,785.48
2.		-32,788,235.51
3.		-0.0277
4.		873,022,222.40
5.		0.9854

: 1、 、 、 不

上 ;

2、 不 、

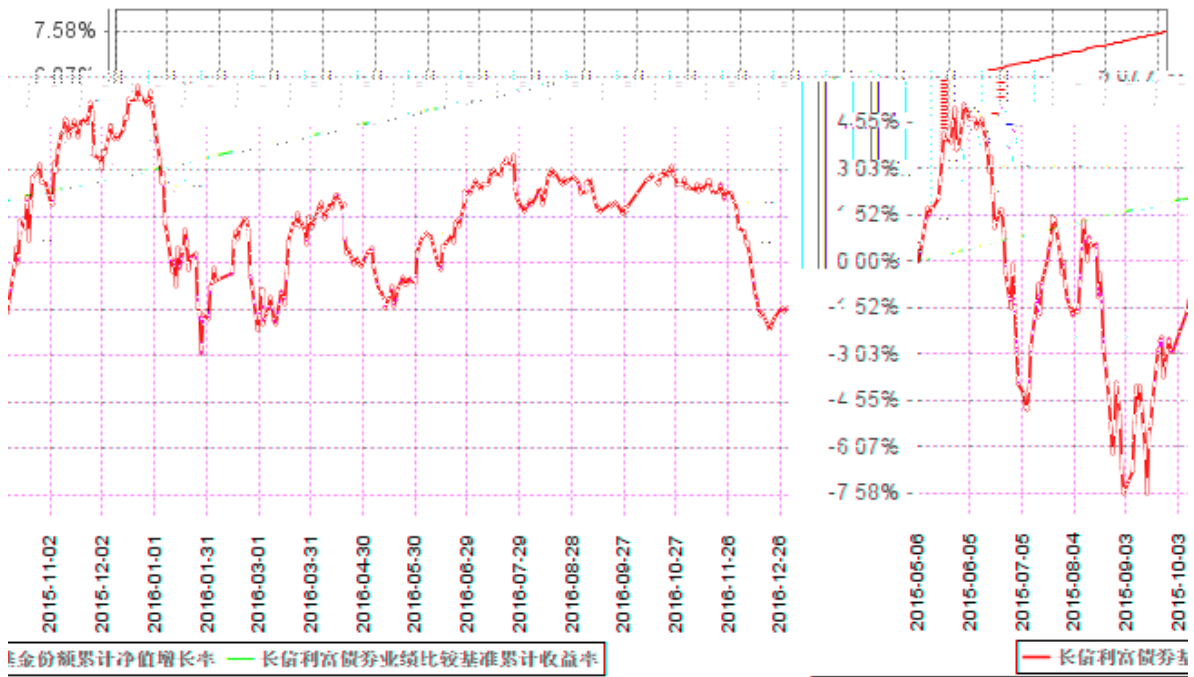
。

3.2

3.2.1 与

三	-3.26%	0.27%	1.07%	0.02%	-4.33%	0.25%

3.2.2 与



：1、 2015 5 6 2016 12 31 。
 2、 6

4

4.1

		2015 5 6	-	18	上
					CIM 。

4.2

《

不

,

。

4.4.2 2017 一

2017 一 与 。

一 、 不 上 不

一 、 上 一

。 一

下 一

。

2017 。

。 与

下 一 不 。

下一

一 。

4.5

2016 12 31 0.9854 0.9854

-3.26% 1.07%。

4.6

。

5

5.1

			%
1		169,295,183.89	18.12
	:	169,295,183.89	18.12
2		-	-

3		724,483,592.55	77.54
	:	724,483,592.55	77.54
		-	-
4		-	-
5		-	-
6		-	-
	:	-	-
7		18,596,522.87	1.99
8		21,975,089.98	2.35
9		934,350,389.29	100.00

:

。

5.2

5.2.2

:

5.3

1	002439		653,369	13,583,541.51	1.56
2	300007		616,035	11,932,597.95	1.37
3	002405		545,843	10,562,062.05	1.21
4	300369		300,000	10,191,000.00	1.17
5	002410		678,136	9,900,785.60	1.13
6	300367		491,264	9,844,930.56	1.13
7	002373		686,084	9,467,959.20	1.08
8	002609		584,132	9,346,112.00	1.07
9	300166		447,233	9,297,974.07	1.07
10	002230		335,250	9,081,922.50	1.04

5.4

1		-	-
2		-	-
3		120,480,000.00	13.80
	:	120,480,000.00	13.80
4		604,003,592.55	69.19
5		-	-
6		-	-
7		-	-
8		-	-
9		-	-
10		724,483,592.55	82.99

5.5

1	120415	12 15	1,000,000	100,360,000.00	11.50
2	1480283	14	400,000	43,024,000.00	4.93
3	1580049	15	400,000	41,888,000.00	4.80

4	124324	13	400,000	33,348,000.00	3.82
5	1480003	14	300,000	32,613,000.00	3.74

5.6

:

5.7

:

5.8

:

5.9**5.9.1**

:

5.9.2

:

5.9.3

:

5.10**5.10.1**

— 、 。

5.10.2

。

不

5.10.3

1		147,158.43
2		1,113,364.90
3		-

8

: °

9

9.1

- 1、 ;
- 2、《 ;
- 3、《 ;
- 4、《 ;
- 5、 上 ;
- 6、 、 °

9.2

°

9.3

: <http://www.cxfund.com.cn>。

2017 1 21