

2016

2016 6 30

付光
光

2016 8 26

1

价

付

光

2016 8 24

分

价

分

2016 1 1

2016 6 30

2

2.1

	519957	
	2015 7 6	
	付光	
	光	
	95,168,063.55	
	A	C
	A	C
	519957	519956
	15,755,740.59	79,412,322.96

2.2

1	分 充 享
2	
1	" "
	仔
2	
	光 书
3	
	分 估
	分

	4
	300 充

2.3

		付光	光
		021-61009999	020-87555888
		zhouyg@cxfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
		4007005566	95575
份		021-61009800	020-87555129

2.4

	www.cxfund.com.cn
	68 9 183 187 价 40

3

3.1 价

伪

	A	C
3.1.1	(2016 1 1 -2016 6 30)	(2016 1 1 - 2016 6 30)
	-2,682,919.11	-12,651,444.14
分	-3,835,364.26	-20,621,033.91
分	-0.2187	-0.2429
	-18.20%	-18.67%
3.1.2	(2016 6 30)	
分	-0.0245	-0.0368
	15,369,374.37	76,487,396.66
	0.975	0.963

1

分

光 仔

分

光 仔

2

分

3.2

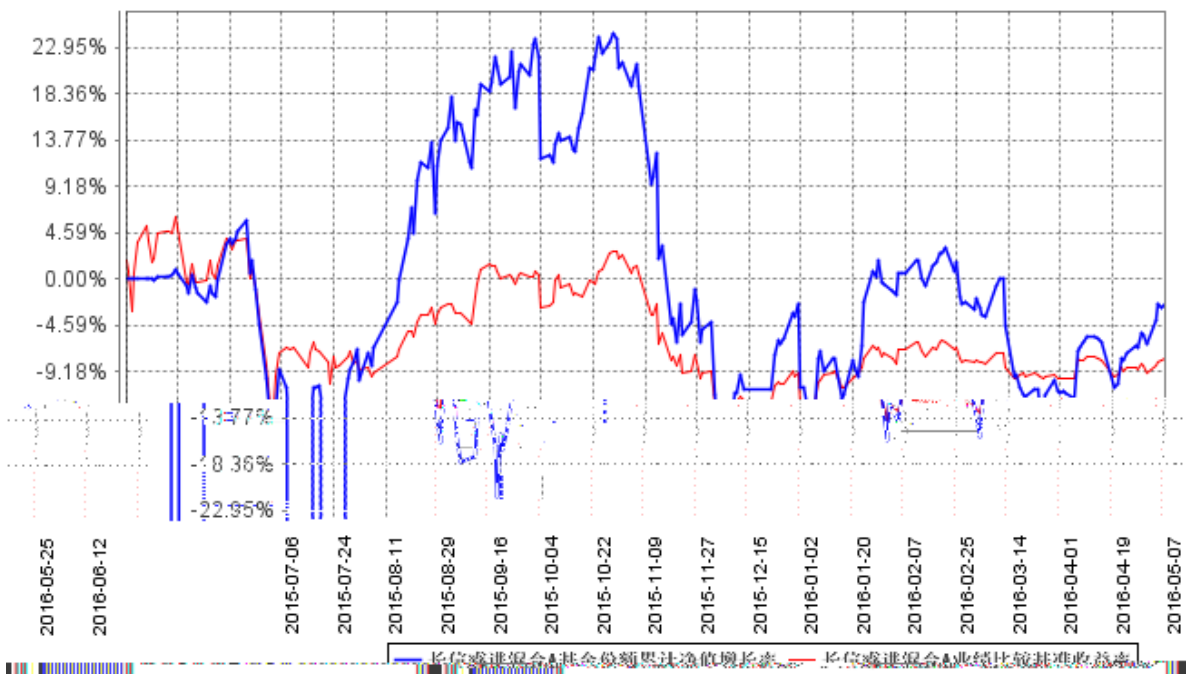
3.2.1

	4.90%	1.58%	0.01%	0.59%	4.89%	0.99%
	-3.31%	1.74%	-0.98%	0.61%	-2.33%	1.13%
	-18.67%	2.66%	-8.55%	1.11%	-10.12%	1.55%
产	-3.70%	2.66%	-7.93%	1.35%	4.23%	1.31%

3.2.2

3.2.2.1

A



3.2.2.2

C

4

4.1

4.1.1

光 付光 价 2003 63
 光 光 光 1.5
 光 49% 光
 34.33% 光 16.67%
 2016 6 30 37 分
 分 分 分 分 分不
 分 分 分 100 QDII) 分 (LOF)
 分 (LOF)
 分 分 分
 分 分 分 LOF
 分
 充 分 QDII
 分

4.2

		付		享	
		付	付		
	分 分 光 价	2015 7 6	-	12	享 争 享 2004 8 付光 付 付 付光

					价 分 分
--	--	--	--	--	-------------

1 付 付 /
光
2 享

4.3

分 分

价 光

分

4.4 光

4.4.1 光

光 光 光 估 估

光

光
光

4.4.2

充

光 仔

5%

4.5

4.5.1

光

4.7

价 2008 9 12

2008 38

付光

光

充

不

光

价

1/2

光

价

光

付 分

仔

4.8

分

分

1

仓

12

3

2

A

C

分

予

3

分

分

分

4

伪

5

享

4.9

5

5.1

付
分 充

5.2

分
付光
仔
分
付
分
分

5.3

付光
2016 分 价

6 价

6.1

价 估

2016 6 30

伪

	2016 6 30	2015 12 31
	11,649,145.56	7,386,507.62
	38,286.51	1,209,956.20
	199,984.60	603,475.91
	81,546,767.42	123,049,020.85
	81,546,767.42	123,049,020.85
	-	-
	-	-
	-	-
	-	-
	-	-
	-	-
	-	-
	-	-
	-	-
分	2,200.03	3,554.11
分	-	-
	50,328.76	472,575.64
	-	-
	-	-
	93,486,712.88	132,725,090.33
	2016 6 30	2015 12 31
	-	-
	-	-
	-	-
	-	-
	225.00	-
	1,208,026.79	1,314,096.90
	112,545.87	170,127.66
	18,757.64	28,354.63
	49,961.44	76,949.80
	110,817.11	429,914.00

		-	-
分		-	-
分		-	-
		-	-
		129,608.00	200,157.10
		1,629,941.85	2,219,600.09
		95,168,063.55	110,129,186.63
分		-3,311,292.52	20,376,303.61
		91,856,771.03	130,505,490.24
		93,486,712.88	132,725,090.33

1	2016 6 30	0.965	95,168,063.55
	A	0.975	C
	0.963	79,412,322.96	
2	2015 7 6		

6.2 分

价 估

2016 1 1 2016 6 30

伪

	2016 1 1	2016 6 30
		-22,655,847.43
1.分		47,624.27
分		47,624.27
分		-
分		-
分		-
2.	-	-13,776,453.30
		-14,235,357.32
		-
		-
		-
		-
分		458,904.02
3.光 仔	-	-9,122,034.92

4.	-	-
5.	-	195,016.52
		1,800,550.74
1		719,973.01
2		119,995.48
3		317,755.50
4		

-			
	95,168,063.55	-3,311,292.52	91,856,771.03

2016 1 1 2016 6 30

2015 7 6

6.1 6.4

_____ 价 _____ 价

6.4

6.4.1

(价 (价
 [2015]1164) 付光 (2015

7 6

付光 光 (308,524,024.87
 2015 6 17 2015 6 30
 分 80,129.80 308,604,154.67
 价 (件) 1500365

价 光
 价 价
 (价)

0%-95%
 5%-100%
 3%
 5%
 光
 价 光 价

6.4.2 价

(
 价 价 XBRL 3
 < > 价 2012 11 16
 价

6.4.3 价

价 2016 6 30
 2016 1 1 2016 6 30

6.4.4 价 价

6.4.4.1 价 价

价 价

6.4.4.2

价

6.4.5

[1998]55

[2002]128

[2004]78

[2012]85

价

光 分

[2005]103

[2008]16

2008 9 18

[2008]1

(1)

(2)

仔

(3)

仔

(4)

分

分

光

20%

2013

1

1

分

1

1

分 充

1

1

1

50%

1

2013

1

1

2015

9

7

25%

2015

9

8

(5)

0.1%

(6)

(

)享

6.4.6

6.4.6.1

分

分

6.4.6.2

付光	
光	

6.4.7

6.4.7.1

6.4.7.1.1

伪

	2016	1	1	2016	6	30

	328,921,071.18	100.00%
2015 7 6		

6.4.7.1.2

6.4.7.1.3

6.4.7.1.4

6.4.7.1.5

伪

	2016 1 1 2016 6 30			
	306,324.38	100.00%	110,817.11	100.00%

1 2015 7 6

2

= () - () -

()

= () - () - () -

()

伪

光

享

光

6.4.7.2

6.4.7.2.1

伪

	2016 1 1	2016 6 30
		719,973.01
		338,511.45

1 2015 7 6

2 1.50%

H " H E

6.4.7.2.2

伪

	2016 1 1	2016 6 30
		119,995.48

1 2015 7 6

2 0.25%

H " H E

6.4.7.2.3

伪

	2016 1 1 2016 6 30		
	A	C	
	付	-	7,187.01
光	-	225,764.49	225,764.49
	-	137.89	137.89
	-	233,089.39	233,089.39

1 2015 7 6

2 A C 0.80%

C 0.80%

H "

H C

E C

6.4.7.3

()

()

6.4.7.4**6.4.7.4.1****6.4.7.4.2****6.4.7.5**

分

伪

	2016 1 1		2016 6 30	
			分	
	11,649,145.56		41,965.70	

1 2015 7 6

2

付光 2016 6 30 38,286.51 2015 12 31
1,209,956.20

6.4.7.6**6.4.7.7**

仓

仔

仔

6.4.8 2016 6 30**6.4.8.1** /

伪

6.4.8.1.1				
			仔	仔 伪

		29	7	7						
--	--	----	---	---	--	--	--	--	--	--

6.4.8.2

伪

				仔		仔				
000718		2016 1 4		9.91	2016 7 18	11.78	189,250	2,687,757.50	1,875,467.50	-
601611		2016 6 30		20.92	2016 7 1	23.01	2,369	8,220.43	49,559.48	-

6.4.8.3

7

7.1

伪

			%
1		81,546,767.42	87.23
		81,546,767.42	87.23
2		-	-
		-	-
		-	-
3		-	-
4		-	-
5		-	-
		-	-
6		11,687,432.07	12.50
7		252,513.39	0.27
8		93,486,712.88	100.00

7.2

7.2.1

伪

		光 仔	(%)
A		-	-
B		-	-
C		42,038,771.08	45.77
D		-	-
E		49,559.48	0.05
F		-	-
G		-	-
H		-	-
I	份 仓	6,012,782.06	6.55

J		24,947,872.00	27.16
K		1,875,467.50	2.04
L		6,118,000.00	6.66
M		11,671.30	0.01
N	分 光	-	-
O		-	-
P		-	-
Q	价	492,644.00	0.54
R	估 中	-	-
S		-	-
		81,546,767.42	88.78

7.2.2

7.3 光 仔

伪

				光 仔	
1	002625		199,600	8,778,408.00	9.56
2	600990		99,904	8,660,677.76	9.43
3	601198	兑	323,500	7,906,340.00	8.61
4	000796	凌	350,000	6,118,000.00	6.66
5	601688		300,000	5,676,000.00	6.18
6	002544		129,803	4,162,782.21	4.53
7	002500		233,000	3,858,480.00	4.20
8	600369		500,000	3,630,000.00	3.95
9	002428		204,150	3,507,297.00	3.82
10	300026		200,000	3,478,000.00	3.79

付光

www.cxfund.com.cn

7.4

7.4.1 出 2% 20

伪

				出
1	600990		7,897,622.67	6.05
2	601688		5,451,672.00	4.18
3	000778	兑	4,128,828.00	3.16
4	600146		4,019,231.00	3.08
5	600428		4,004,242.00	3.07
6	000807		3,960,333.30	3.03
7	002308		3,876,085.96	2.97
8	601919		3,698,969.10	2.83
9	000895		3,531,180.00	2.71
10	300026		3,443,341.00	2.64
11	600259		3,440,931.00	2.64
12	002428		3,221,048.57	2.47
13	000687		3,192,547.10	2.45
14	002500		3,125,209.00	2.39
15	300065	免	2,957,862.69	2.27
16	600136		2,735,380.00	2.10
17	600816		2,382,805.64	1.83
18	000960		2,332,887.00	1.79
19	600231		2,143,507.00	1.64
20	600061		2,102,913.59	1.61

仔

7.4.2 出 2% 20

伪

				出
1	600562		12,101,977.77	9.27
2	002023		9,975,301.18	7.64
3	002736		5,686,924.00	4.36
4	601377	兑	5,561,736.50	4.26
5	601555		5,221,037.80	4.00
6	002500		4,439,907.00	3.40
7	600146		4,422,552.70	3.39
8	000750		4,363,106.00	3.34
9	002026		4,353,780.36	3.34
10	002308		4,187,047.55	3.21

11	000687		4,000,303.80	3.07
12	601788		3,870,448.76	2.97
13	000895		3,759,602.22	2.88
14	600259		3,647,008.00	2.79
15	601919		3,579,267.00	2.74
16	000778	兑	3,399,097.00	2.60
17	000807		3,379,089.72	2.59
18	300065	免	3,141,768.66	2.41
19	601099		3,119,429.00	2.39
20	600136		3,108,896.00	2.38
21	601901		3,099,088.00	2.37
22	600428		2,855,658.29	2.19
23	000960		2,775,091.27	2.13

仔

7.4.3

伪

	156,389,509.97
	174,534,371.16

仔

7.5**7.6 光 仔****7.7 光 仔**

7.8 光 仔

7.9 光 仔

7.10

7.11

7.12

7.12.1 600990 估 2015

12 23 光

付 2015 56

光

分

2.1 7.5 12.2 光 付 价 光

光 付

2.2 3.1.4 3.2.2

600369 估 2016

6 23 价 价

2016975 光

价 价 光

			601688	估 2015
8	24	价		2015004
	光		价 光	
估		仓		
估		仓	仔	
			估	
		光		

7.12.2

7.12.3

伪

1		199,984.60
2		-
3	分	-
4	分	2,200.03
5		50,328.76
6		-
7		-
8		-
9		252,513.39

7.12.4

7.12.5

8

8.1

伪

	()					
A	1,165	13,524.24	0.00	0.00%	15,755,740.59	100.00%
C	2,631	30,183.32	0.00	0.00%	79,412,322.96	100.00%
	3,796	25,070.62	0.00	0.00%	95,168,063.55	100.00%

8.2

享

享	A	0.00	0.00%
	C	2.06	0.00%
		2.06	0.00%

8.3

享

光	A	0
	C	0
		0
	A	0
	C	0
		0

9

	A	伪 C
2015 7 6	34,971,320.32	273,632,834.35
出	17,226,366.28	92,902,820.35
	9,685,703.45	50,493,081.49
:	11,156,329.14	63,983,578.88
"_"	-	-
	15,755,740.59	79,412,322.96

10 仓

10.1 价

价

10.2

10.2.1

2016 6 3

2016 7 30

付

估

光

10.2.2

10.3

10.4

10.5 价

价

10.6

10.7 光

10.7.1 光

伪

	2	328,921,071.18	100.00%	306,324.38	100.00%	-

1 光

光

2

价

1998 29

伪

2007 48

光

光

1

1 仔

2 仔

3 仔

4 仔

2

光

仔

付光

2016 8 26