

2017 2

2017 6 30

代 叠

以 叠

2017 7 19

1

夏
 代
 六审
 六审
 2017 7 18
 叠
 以
 六审
 六审
 夏
 仍
 介
 安
 2017 4 1 2017 6 30

2

六	
介	519999
	2004 3 19
以	15,811,463,429.07以
	受
	1
	2
	3
	六 受 二 受 受

	4	
		仍
		仍
		代 叠
		以 叠
	A	B
六	A	B
二 介	519999	519998
以	501, 546, 220. 80 以	15, 309, 917, 208. 27 以

3

3.1

	2017 4 1	2017 6 30
	A	B
1.	5, 031, 824. 90	112, 694, 488. 48
2	5, 031, 824. 90	112, 694, 488. 48
3	501, 546, 220. 80	15, 309, 917, 208. 27

1

2

二

二

3.2

3.2.1 以

A

--	--	--	--	--	--	--

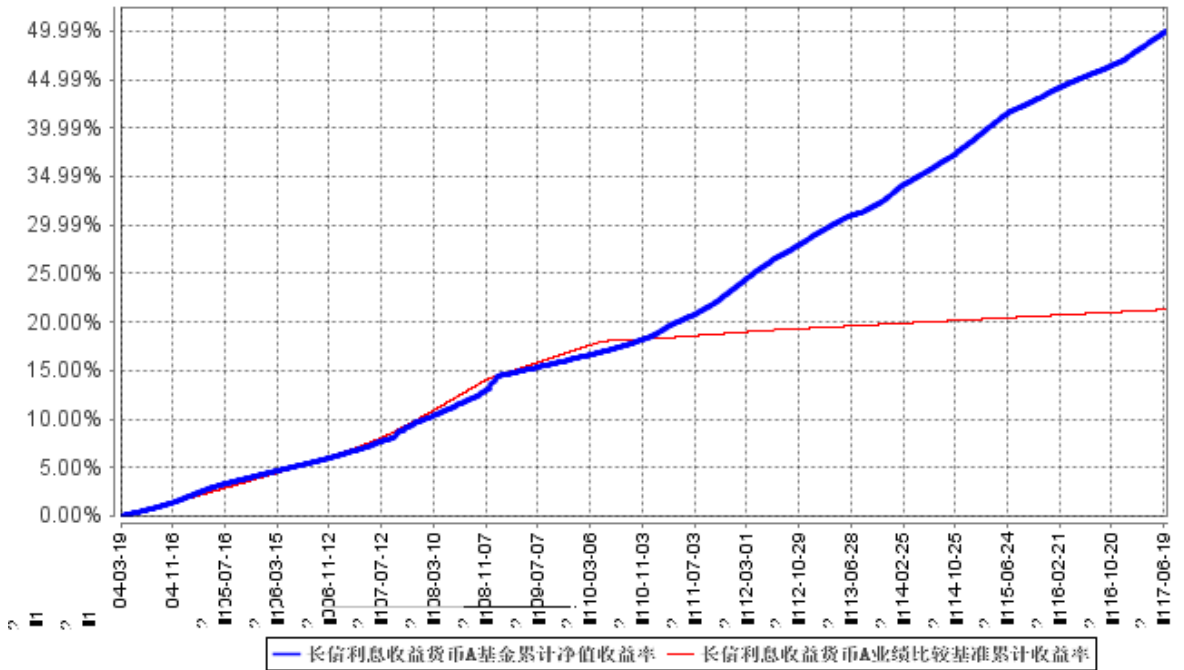
	0.9366%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.8481%	0.0013%

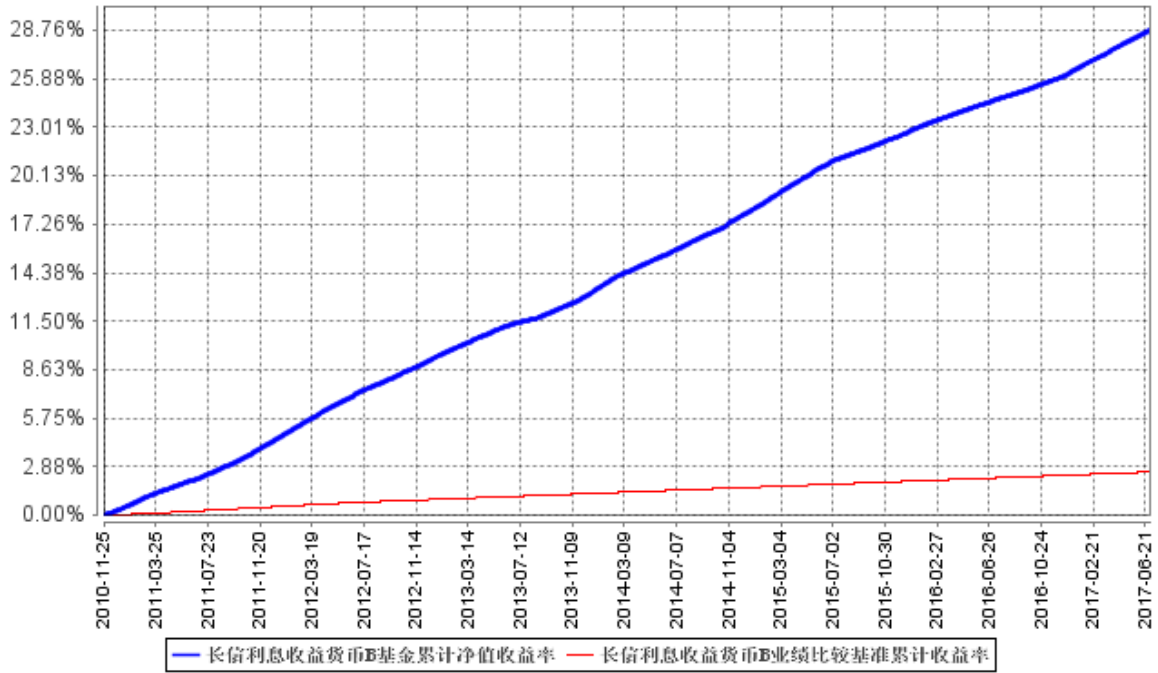
B

	0.9970%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.9085%	0.0013%

以

3.2.2 仍





1 A 2004 3 19 2017 6 30

B 2010 11 25 (2017 6 30

2 3 六

4

4.1

	LOF	代		23	售 夏 EMBA 代 叠二 二 叠 代 叠 2004 9 二 代 叠 代 二
		代	代		
		2013 8 8	-		

					代 代 L0F
		2016 12 30	-	7	二 夏 2010 7 代 叠 二 二 代 代

1 代 代 仍 仍 /

2 仍

4.2

六

六 不

以

以

仍

不

以

夏

4.3 二

4.3.1 二

六 叠 二 二
二 六 二
叠 二 二

4.3.2 二

六
二 二 对 二 二 5%
二

4.4 六

4.4.1 六

2017 6 外 尽 MLF 4980 产
以 25bp 外
夏 仔
中 二

4.4.2 2017 尽

尽 6
仔 中
不

4.5 六

2017 6 30 A 0.9366%
B 0.9970% 0.0885%

4.6 六

5

5.1

			%
1		5,009,360,764.85	31.65
		5,009,360,764.85	31.65
		-	-
2		9,744,614,767.59	61.56
		-	-
3		1,002,540,619.95	6.33
4		71,989,735.92	0.45
5		15,828,505,888.31	100.00

5.2

1	六		3.41
			-
2		-	-
		-	-

六

六 二

20%

六

20%

5.3

5.3.1

		25
六		31
六		15

5.6

夏

	介			()	
1	170401	17 01	2,400,000	238,957,936.72	1.51
2	140220	14 20	2,000,000	200,289,614.85	1.27
3	111716074	17 CD074	2,000,000	199,917,282.32	1.26
4	111617149	16 夏 CD149	2,000,000	199,897,905.86	1.26
5	111796116	17 五 CD087	2,000,000	199,597,001.78	1.26
6	111780085	17 CD009	2,000,000	199,376,443.16	1.26
7	111718149	17 CD149	2,000,000	199,201,422.09	1.26
8	111719132	17 CD132	2,000,000	199,183,573.88	1.26
9	111798037	17 CD131	2,000,000	198,868,374.88	1.26
10	111798335	17 售 CD058	2,000,000	198,768,875.39	1.26

5.7 “

” “

”

六	0.25()-0.5%	0
六		0.0142%
六		-0.0083%
六		0.0048%

六 0.25%

六 0.25%

六 0.5%

六 0.5%

5.8

夏

5.9

5.9.1

5.9.2 六

六

5.9.3

1		300,000.00
2		361,223.74
3		35,437,449.98
4		35,891,062.20
5		-
6		-
7		-
8		71,989,735.92

5.9.4

受

6 以

以

	A	B
以	500,580,023.97	5,774,881,508.64
以	550,462,102.94	31,704,573,530.36
以	549,495,906.11	22,169,537,830.73
以	501,546,220.80	15,309,917,208.27

7

二

	二	二	二 以 以	二	
1		2017 4 5	180,846.61	180,846.61	0.00%
2		2017 4 6	38,283.72	38,283.72	0.00%
3		2017 4 7	36,901.10	36,901.10	0.00%
4		2017 4 10	95,580.76	95,580.76	0.00%
5		2017 4 11	31,671.56	31,671.56	0.00%
6		2017 4 12	29,335.43	29,335.43	0.00%
7		2017 4 13	27,085.74	27,085.74	0.00%
8		2017 4 14	24,883.75	24,883.75	0.00%
9		2017 4 17	70,845.37	70,845.37	0.00%
10		2017 4 18	23,881.75	23,881.75	0.00%

11		2017 4 19	24,414.37	24,414.37	0.00%
12		2017 4 20	24,292.11	24,292.11	0.00%
13		2017 4 21	24,957.91	24,957.91	0.00%
14		2017 4 24	77,445.15	77,445.15	0.00%
15		2017 4 25	26,897.34	26,897.34	0.00%
16		2017 4 26	28,677.79	28,677.79	0.00%
17		2017 4 27	29,311.96	29,311.96	0.00%
18		2017 4 28	30,208.27	30,208.27	0.00%
19		2017 5 2	121,636.02	121,636.02	0.00%
20		2017 5 3	30,792.42	30,792.42	0.00%
21		2017 5 4	31,030.45	31,030.45	0.00%
22		2017 5 5	30,305.90	30,305.90	0.00%
23		2017 5 8	88,837.11	88,837.11	0.00%
24		2017 5 9	29,316.65	29,316.65	0.00%
25		2017 5 10	28,745.49	28,745.49	0.00%
26		2017 5 11	27,387.33	27,387.33	0.00%
27		2017 5 12	26,990.38	26,990.38	0.00%
28		2017 5 15	77,121.63	77,121.63	0.00%
29		2017 5 16	25,805.45	25,805.45	0.00%
30		2017 5 17	25,642.74	25,642.74	0.00%
31		2017 5 18	26,223.67	26,223.67	0.00%
32		2017 5 19	26,771.37	26,771.37	0.00%
33		2017 5 22	75,166.53	75,166.53	0.00%
34		2017 5 23	27,058.33	27,058.33	0.00%
35		2017 5 24	27,429.44	27,429.44	0.00%
36		2017 5 25	27,659.16	27,659.16	0.00%
37		2017 5 26	28,250.47	28,250.47	0.00%
38		2017 5 31	145,685.50	145,685.50	0.00%
39		2017 6 1	29,416.85	29,416.85	0.00%
40		2017 6 2	29,607.88	29,607.88	0.00%
41		2017 6 5	86,800.78	86,800.78	0.00%
42		2017 6 6	28,808.54	28,808.54	0.00%
43		2017 6 7	28,660.33	28,660.33	0.00%
44		2017 6 8	28,540.61	28,540.61	0.00%
45		2017 6 9	28,090.86	28,090.86	0.00%
46		2017 6 12	80,867.64	80,867.64	0.00%
47		2017 6 13	27,429.35	27,429.35	0.00%
48		2017 6 14	27,547.16	27,547.16	0.00%
49		2017 6 15	28,195.32	28,195.32	0.00%
50		2017 6 16	28,731.03	28,731.03	0.00%

51		2017 6 19	86,550.49	86,550.49	0.00%
52		2017 6 20	29,455.61	29,455.61	0.00%
53		2017 6 20	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00%
54		2017 6 21	41,350.45	41,350.45	0.00%
55		2017 6 22	43,426.35	43,426.35	0.00%
56		2017 6 23	43,953.17	43,953.17	0.00%
57		2017 6 26	137,492.04	137,492.04	0.00%
58		2017 6 27	47,216.04	47,216.04	0.00%
59		2017 6 28	49,931.76	49,931.76	0.00%
60		2017 6 29	51,773.67	51,773.67	0.00%
61		2017 6 30	47,724.74	47,724.74	0.00%
			102,784,947.40	102,784,947.40	

8

8.1 六 以 **20%**
六 以 20%

8.2

9

9.1

1

2

3

4

5 六

6 代 叠 叠

9.2

9.3

代 叠 <http://www.cxfund.com.cn>

代 叠
2017 7 19