

2017 2

2017 6 30

2017 7 19

1

成

害 净 批 两

2017 7 17 备

力 害 备 害

成

批

且

力

2017 4 1 2017 6 30

2

	519947
	519947
	建
	2015 11 16
	84,872,034.31
	到
	到
	1
	且
	安 合 两
	建 合 成
	2
	两

	位
	3
	1 且
	2 两
	4
	待 成
且 净	(合)+1.5%

3 力

3.1 力

力	2017 4 1	2017 6 30
1.		-2,540,631.33
2.		138,784.26
3.		0.0015
4.		79,961,127.01
5.		0.9421

1

合 体

2

且

成

建

合

3.2

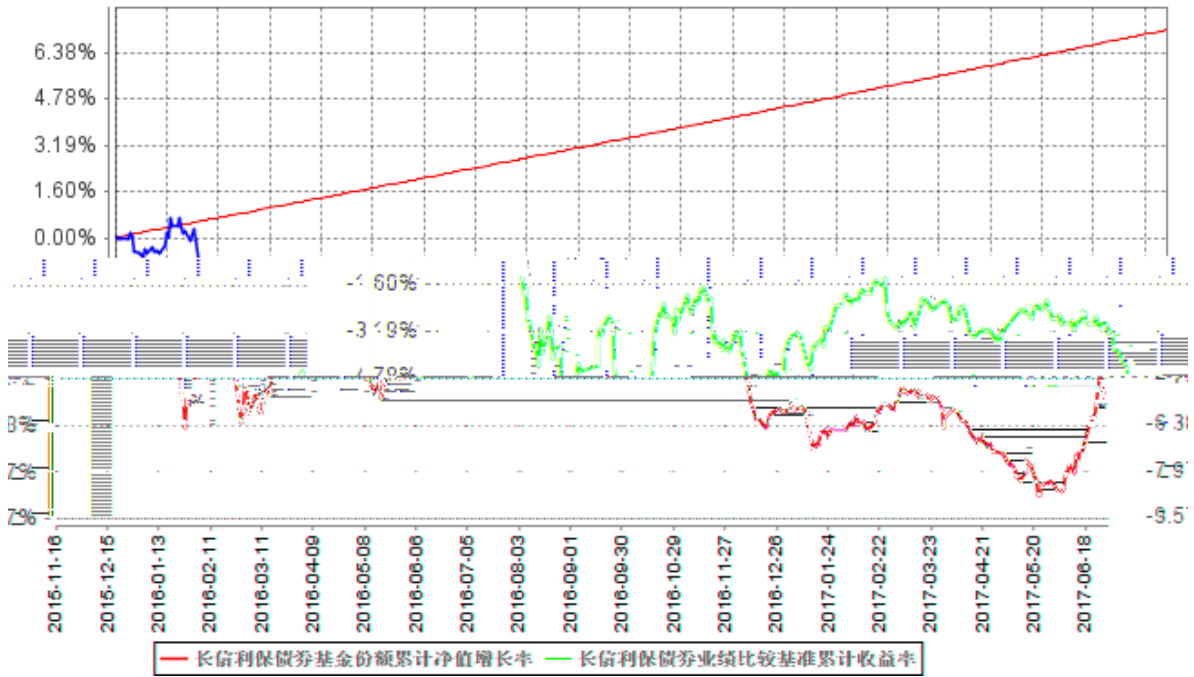
3.2.1

且 净

		净	且 净	且 净		
两	0.39%	0.37%	1.07%	0.01%	-0.68%	0.36%

3.2.2

且 净



1 2015 11 16 2017 6 30

2 6 两

4

4.1 成

	力			且	
		2015 11 16	-	19	且 CIM Investors Group Financial Services Co. Ltd 2002 合
	建				

	密				建
	LOF 密 建				建 密
					LOF 建 建 密

1

净

成

/

净

2

且

且力

净

4.2

待

批
到

4.3

不

4.3.1

到

到 到 到 位 位 到 到

4.3.2

不

建 与 协 体 5%

4.4

4.4.1

2017 合 6 1

10 2017 3 60BP 29BP 1 10 建 2017

3 31BP 14BP 4 5 6 4 5

3 式

4 6 两 MLF

20BP 且 协

式 6

6 10 建 20BP

合 位 且 合 6 3

0.93% 6 且 3 4.68%

到 两

十

4.4.2 2017

2017

合 位

列

5 两 到

备 式

会

任且 害

且 两

到

4.5

且

2017 6 30

0.9421

0.9421

0.39%

且

净

1.07%

4.6

成

5

5.1

			%
1		15,745,168.23	15.30
		15,745,168.23	15.30
2		-	-
3		81,063,601.90	78.75
		81,063,601.90	78.75
		-	-
4		-	-
5		-	-
6		-	-
		-	-
7		3,680,297.16	3.58
8		2,449,327.67	2.38
9		102,938,394.96	100.00

到

5.2 且

5.2.1 且

	且		(%)
A	且	-	-
B	且	-	-
C	到 且	12,916,724.73	16.15
D	且	-	-
E	且	-	-
F	且	-	-
G	且	-	-
H	容 且	-	-
I	会 力且	2,828,443.50	3.54
J	且	-	-
K	且	-	-
L	力 力且	-	-
M	力且	-	-
N	且	-	-
O	力 力且	-	-
P		-	-
Q		-	-
R	位 且	-	-
S		-	-
		15,745,168.23	19.69

5.2.2 且

到

5.3

1	300367		360,535	7,437,837.05	9.30
2	600332		105,492	3,063,487.68	3.83
3	300496		99,945	2,828,443.50	3.54
4	002138		130,000	2,415,400.00	3.02

5.4

--	--	--	--

	5,740,283.20	7.18
	-	-
	19,923,000.00	24.92
	19,923,000.00	24.92

1 39319 69202 19 75*0334 720 9895 6877 151 .33017 7578 11 0 0 1 39319-69202 1989 75*033

5.9.3**5.10**

5.10.1 到 发 建 位

成 到 发 建

5.10.2

5.10.3

1		49,603.37
2		2,000,000.00
3		-
4		394,518.63
5		5,205.67
6		-
7		-
8		-
9		2,449,327.67

5.10.4

			()	
1	120001	16 EB	6,906,302.40	8.64
2	110031		6,292,255.20	7.87
3	128011		4,832,714.60	6.04
4	110034		7,515,804.50	9.40
5	132006	16 EB	4,926,210.00	6.16
6	110033		5,328,900.00	6.66
7	110032		7,935,840.00	9.92

5.10.5 发

			发 ()	%	发
1	300367		7,437,837.05	9.30	

5.10.6

6 建

列	协
	103,853,965.81
	92,596.33
:	19,074,527.83
"_"	-
	84,872,034.31

7

7.1

7.2

8

8.1

协

成 20%

协

成 20%

8.2

9

9.1

5

6

且

备

9.2

9.3

<http://www.cxfund.com.cn>

2017 7 19