2017

2017   6   30

2017   8   24

1.2

2

2.1

	519967
	519967
	2015　5　6
	785, 835, 602. 65

2.2

	1
	2
	3 　1 　2

	4
	(　　)＋1.5%

2.3

		021-61009999	010-66105799
		zhouyg@cxfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
	4007005566	95588
	021-61009800	010-66105798
	68　9	55
	68　9	55
	200120	100140

2.4

	www.cxfund.com.cn
	68　9 55

2.5

		17

3

3.1

3.1.1	(2017　1　1　－　2017　6　30　)
	−22,278,491.76
	1,110,957.61
	0.0014
	0.14%
	0.20%
3.1.2	（2017　6　30　）
	−38,070,738.34
	−0.0484
	775,916,259.66
	0.9874
3.1.3	（2017　6　30　）
	−1.26%

1

2

3

3.2

3.2.1

	2.81%	0.24%	0.35%	0.01%	2.46%	0.23%
	−0.06%	0.23%	1.07%	0.01%	−1.13%	0.22%
	0.20%	0.22%	2.14%	0.01%	−1.94%	0.21%
	−3.51%	0.24%	4.34%	0.01%	−7.85%	0.23%
	−1.26%	0.56%	9.85%	0.01%	−11.11%	0.55%

3.2.2

长信利富债基金份额累计净值增长率 —— 长信利富债业绩比较基准收益率

1 2015 5 6 2017 6 30

2 6

4

4.1

4.1.1

2003　63

1. 65

44. 55%

31. 21%　　　　　　　　　15. 15%　　　　　　　　　　　　4. 55%

4. 54%

2017　6　30　　　　　　　　　　49

100　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　(LOF)

(LOF)

LOF

LOF

LOF

4.1.2

LOF		2015　5　6	–	19	CIM Investors Group　Financial Services Co.　Ltd　2002 LOF

		2016 12 12	–	4	5 2016

1   /

2

3   2017   8   8

4.2

4.3

4.3.1

4.3.2

5%

4.4

4.4.1

2017

,

4.4.2

0. 9874 0. 20%

0. 9874 2. 14%

4. 5

，

4.6

2008　9　12　　　　[2008]38

1/2

4.7

1　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　　12

3

14　　　55

2

3

4

5

4.8

5

5.1

5.2

5.3

2017

6

6.1

2017 6 30

		2017 6 30	2016 12 31
	6.4.6.1	17,397,436.62	17,423,404.70
		1,253,468.00	1,173,118.17
		140,846.94	147,158.43
	6.4.6.2	963,859,664.04	893,778,776.44
		138,318,990.34	169,295,183.89
		–	–
		825,540,673.70	724,483,592.55
		–	–
		–	–
	6.4.6.3	–	–
	6.4.6.4	–	–
		17,509,054.73	1,113,364.90
	6.4.6.5	16,138,408.98	20,713,175.07
		–	–
		–	1,391.58
		–	–
	6.4.6.6	1,928,200.00	–
		1,018,227,079.31	934,350,389.29
		2017 6 30	2016 12 31
		–	–
		–	–
	6.4.6.3	–	–
		236,121,174.82	59,999,790.00
		4,573,231.72	–
		1,819.68	59,044.98
		439,293.49	572,432.50
		125,512.42	163,552.16
		–	–
	6.4.6.7	739,631.53	170,623.88

		–	–
		97, 427. 58	52, 722. 72
		–	–
		–	–
	6.4.6.8	212, 728. 41	310, 000. 65
		242, 310, 819. 65	61, 328, 166. 89
	6.4.6.9	785, 835, 602. 65	885, 983, 493. 77
	6.4.6.10	−9, 919, 342. 99	−12, 961, 271. 37
		775, 916, 259. 66	873, 022, 222. 40
		1, 018, 227, 079. 31	934, 350, 389. 29

2017   6   30   0. 9874   785, 835, 602. 65

6.2

2017   1   1   2017   6   30

		2017 1 1 2017 6 30	2016 1 1 2016 6 30
		8, 256, 694. 30	−77, 004, 674. 04
1.		23, 374, 076. 70	46, 221, 279. 42
	6.4.6.11	132, 323. 78	869, 705. 05
		23, 226, 645. 05	45, 280, 803. 49
		–	–
		15, 107. 87	70, 770. 88
		–	–
2. -		−38, 545, 682. 59	−81, 906, 726. 60
	6.4.6.12	−37, 435, 086. 93	−78, 819, 364. 00
		–	–
	6.4.6.13	−1, 734, 749. 39	−4, 058, 613. 05
	6.4.6.13.5	–	–
	6.4.6.14	–	–
	6.4.6.15	–	–
	6.4.6.16	624, 153. 73	971, 250. 45
3. -	6.4.6.17	23, 389, 449. 37	−43, 743, 661. 73
4. -		–	–
5. -	6.4.6.18	38, 850. 82	2, 424, 434. 87

		7, 145, 736. 69	17, 632, 294. 20
1	6.4.9.2.1	2, 775, 323. 94	7, 732, 680. 13
2	6.4.9.2.2	792, 949. 67	2, 209, 337. 19
3	6.4.9.2.3	−	−
4	6.4.6.19	1, 230, 230. 25	2, 332, 820. 86
5		2, 159, 947. 91	5, 170, 950. 46
		2, 159, 947. 91	5, 170, 950. 46
6	6.4.6.20	187, 284. 92	186, 505. 56
−		1, 110, 957. 61	−94, 636, 968. 24
		−	−
−		1, 110, 957. 61	−94, 636, 968. 24

6.3

2017 1 1 2017 6 30

	2017 1 1 2017 6 30		
	885, 983, 493. 77	−12, 961, 271. 37	873, 022, 222. 40
	−	1, 110, 957. 61	1, 110, 957. 61
-	−100, 147, 891. 12	1, 930, 970. 77	−98, 216, 920. 35
1.	628, 054. 99	−10, 207. 67	617, 847. 32
2.	−100, 775, 946. 11	1, 941, 178. 44	−98, 834, 767. 67
-	−	−	−
	785, 835, 602. 65	−9, 919, 342. 99	775, 916, 259. 66
	2016 1 1 2016 6 30		

		20	55		

(   )

80%

20%

5%   :   (   )+1. 5%

6.4.2

(

XBRL   3

〈   〉   2012   11   16

6.4.3

2017   6

30   2017   1   1   2017   6   30

6. 4. 4

6.4.4.1

6.4.4.2

6.4.5

〔1998〕55

〔2002〕128   〔2004〕78

〔2012〕85

〔2015〕101

〔2005〕103

〔2008〕16

2008   9   18

〔2008〕1

〔2016〕36

〔2016〕140

〔2017〕2

〔2017〕56   〔2015〕125

(a)

(b)

(c)   2016   5   1   ,

,

2018   1   1

3%

(d)

(e)

20%   2013   1   1

	–
1–3	–
	–
	17,397,436.62

6.4.6.2

	2017 6 30		
	134,265,186.74	138,318,990.34	4,053,803.60
–	–	–	–
	183,518,521.77	184,750,681.70	1,232,159.93
	643,418,440.17	640,789,992.00	−2,628,448.17
	826,936,961.94	825,540,673.70	−1,396,288.24
	–	–	–
	–	–	–
	–	–	–
	961,202,148.68	963,859,664.04	2,657,515.36

6.4.6.3   /

/

6.4.6.4

6.4.6.4.1

6.4.6.4.2

6.4.6.5

	2017 6 30
	3,067.25
	–

	2017
	−
	−
	57.06
	16,138,408.98

6.4.6.6

	2017 6 30
	1,928,200.00
	−
	1,928,200.00

6.4.6.7

	2017 6 30
	733,406.09
	6,225.44
	739,631.53

6.4.6.8

	2017 6 30
	−
	1.49
	212,726.92
−	−
−	−
−	−
	−
	212,728.41

6.4.6.9

	2017 1 1	2017 6 30
	885,983,493.77	885,983,493.77

		628, 054. 99	628, 054. 99
（　"-"　）		−100, 775, 946. 11	−100, 775, 946. 11
—　　／		—	—
／		—	—
		—	—
（　"-"　）		—	—
		785, 835, 602. 65	785, 835, 602. 65

——	–
	–
	−37, 435, 086. 93

6.4.6.12.2

	2017　1　1　2017　6　30
	459, 249, 706. 96
	496, 684, 793. 89
	−37, 435, 086. 93

6.4.6.13

6.4.6.13.1

	2017　1　1　2017　6　30
	−1, 734, 749. 39
	–
	–
	−1, 734, 749. 39

6.4.6.13.2

	2017　1　1　2017　6　30
	285, 430, 933. 02
	267, 317, 717. 93
	19, 847, 964. 48
	−1, 734, 749. 39

6.4.6.13.3

6.4.6.13.4

6.4.6.13.5

6.4.6.14

6.4.6.14.1

6.4.6.15

6.4.6.15.1

6.4.6.15.2

6.4.6.16

	2017 1 1 2017 6 30
	624,153.73
	–
	624,153.73

6.4.6.17

	2017 1 1 2017 6 30
1.	23,389,449.37
	31,221,006.26
	−7,831,556.89
	–
	–
	–
2.	–
	–
3.	–
	23,389,449.37

6.4.6.18

	2017　1　1　2017　6　30
	38,805.69
	45.13
	-
	38,850.82

25%

6.4.6.19

	2017　1　1　2017　6　30
	1,226,685.25
	3,545.00
	1,230,230.25

6.4.6.20

	2017　1　1　2017　6　30
	24,795.19
	128,931.73
	27,600.00
	5,958.00
	187,284.92

6.4.7

6.4.7.1

6.4.7.2

6.4.8

6.4.8.1

2017   2   8

6.4.8.2

6.4.9

6.4.9.1.1

6.4.9.1.2

6.4.9.1.3

6.4.9.1.4

6.4.9.1.5

6.4.9.2

6.4.9.2.1

	2017 1 1 2017 6 30	2016 1 1 2016 6 30
	2,775,323.94	7,732,680.13
	195,383.62	348,553.47

0.70%

= !

6.4.9.2.2

	2017 1 1 2017 6 30	2016 1 1 2016 6 30
	792,949.67	2,209,337.19

0.20%

= 0.20%/

6.4.9.3 ( )

( )

6.4.9.4

6.4.9.4.1

6.4.9.4.2

6.4.9.5

	2017 1 1 2017 6 30		2016 1 1 2016 6 30	
	17,397,436.62	126,039.50	21,172,139.69	800,232.72

31   1, 173, 118. 17

6.4.9.6

6.4.9.7

6.4.10

6.4.11　　**2017**　**6**　**30**

6.4.11.1　　　**/**

/

6.4.11.2

300367	2016 12 15	20. 63	–	–	491, 264	12, 101, 664. 98	10, 134, 776. 32	–

6.4.11.3

6.4.11.3.1

2017　6　30

150, 121, 174. 82

1280458	12	2017　7　4	61. 79	170, 000	10, 504, 300. 00
1480003	14	2017　7　4	85. 53	300, 000	25, 659, 000. 00

1480583	14	2017	7	4	102. 76	200, 000	20, 552, 000. 00
1480313	14	2017	7	5	83. 50	162, 000	13, 527, 000. 00
1480326	14	2017	7	5	83. 78	200, 000	16, 756, 000. 00
1480429	14	2017	7	5	105. 13	200, 000	21, 026, 000. 00
1280261	12	2017	7	6	51. 31	400, 000	20, 524, 000. 00
1280427	12	2017	7	6	61. 35	300, 000	18, 405, 000. 00
1480124	14	2017	7	6	85. 44	197, 000	16, 831, 680. 00
						2, 129, 000	163, 784, 980. 00

6.4.11.3.2

2017   6   30

86, 000, 000. 00   2017   7   3

／

6.4.12

6.4.12.1

6.4.12.2

10%

　10%

6.4.12.2.1

6.4.12.2.2

	2017　6　30	2016　12　31
AAA	76,554,617.70	0.00
AAA	514,571,992.00	604,003,592.55
	234,414,064.00	120,480,000.00
	825,540,673.70	724,483,592.55

2006   3   29

( )

6.4.12.4

6.4.12.4.1

6.4.12.4.1.1

2017 6 30	6	6 −1	1−5	5		
	17, 397, 436. 62	−	−	−	−	17, 397, 436. 62
	1, 253, 468. 00	−	−	−	−	1, 253, 468. 00
	140, 846. 94	−	−	−	−	140, 846. 94
	57, 427, 000. 00	23, 572, 000. 00	516, 135, 992. 00	228, 405, 681. 70	138, 318, 990. 34	963, 859, 664. 04
	−	−	−	17, 509, 054. 73	17, 509, 054. 73
	−	−	−	16, 138, 408. 98	16, 138, 408. 98
	−	−	−	−	1, 928, 200. 00	1, 928, 200. 00

	76,218,751.56	23,572,000.00	516,135,992.00	228,405,681.70	173,894,654.05	1,018,227,079.31
	236,121,174.82	−	−	−	−	236,121,174.82
	−	−	−	−	4,573,231.72	4,573,231.72
	−	−	−	−	1,819.68	1,819.68
	−	−	−	−	439,293.49	439,293.49
	−	−	−	−	125,512.42	125,512.42
	−	−	−	−	739,631.53	739,631.53
	−	−	−	−	97,427.58	97,427.58
	−	−	−	−	212,728.41	212,728.41
	236,121,174.82	−	−	−	6,189,644.83	242,310,819.65
	−159,902,423.26	23,572,000.00	516,135,992.00	228,405,681.70	167,705,009.22	775,916,259.66
2016 12 31	6	6 −1	1−5	5		
	17,423,404.70	−	−	−	−	17,423,404.70
	1,173,118.17	−	−	−	−	1,173,118.17
	147,158.43	−	−	−	−	147,158.43
	26,245,900.35	105,341,000.00	519,652,692.20	73,244,000.00	169,295,183.89	893,778,776.44
	−	−	−	−	1,113,364.90	1,113,364.90

			38				
		–	–	–	–	20, 713, 175. 07	20, 713, 175. 07
		–	–	–	–	1, 391. 58	1, 391. 58

	27	−7,012,030.59	−3,710,670.24

6.4.12.4.2

6.4.12.4.3

VaR (Value at Risk)

6   30

6.4.12.4.3.1

	2017 6 30		2016 12 31	
		%		%
−	138,318,990.34	17.83	169,295,183.89	19.39

		30	31
	VaR 0.32% 2016 12 31 VaR 0.87%)	−2,505,275.63	−7,595,293.33

VaR

95%

2016

6.4.13

(1)

(a)

	2017 6 30			
	−	−	−	−
	10,134,776.32	128,184,214.02	−	138,318,990.34
	−	825,540,673.70	−	825,540,673.70
	10,134,776.32	953,724,887.72	−	963,859,664.04

2017

(b)

(
)

2017

(c)

2017　6　30

(2)　　　　　　　　　　　(　　　　　　　　　　　)

7

7.1

			%
1		138, 318, 990. 34	13. 58
		138, 318, 990. 34	13. 58
2		825, 540, 673. 70	81. 08
		825, 540, 673. 70	81. 08
		–	–
3		–	–
4		–	–
5		–	–
		–	–
6		18, 650, 904. 62	1. 83
7		35, 716, 510. 65	3. 51
8		1, 018, 227, 079. 31	100. 00

7.2

7.2.1

			(%)
A		–	–
B		–	–
C		107, 788, 348. 24	13. 89
D		–	–
E		–	–
F		–	–
G		–	–
H		–	–
I		21, 281, 534. 80	2. 74
J		–	–
K		9, 249, 107. 30	1. 19
L		–	–

M		–	–
N		–	–
O		–	–
P		–	–
Q		–	–
R		–	–
S		–	–
		138, 318, 990. 34	17. 83

7.2.2

7.3

7.4

7.4.1   **2%**   **20**

1	000063			

6	600887		14, 415, 958. 42	1. 65
7	300078		13, 783, 296. 37	1. 58
8	300007		12, 513, 063. 34	1. 43
9	002410		11, 180, 417. 06	1. 28
10	300059		10, 929, 204. 77	1. 25
11	300020		10, 735, 458. 10	1. 23
12	300369		10, 720, 230. 22	1. 23
13	002074		9, 862, 145. 74	1. 13
14	002609		9, 587, 249. 74	1. 10
15	300166		9, 297, 882. 67	1. 07
16	002373		9, 292, 584. 51	1. 06
17	600340		8, 859, 838. 28	1. 01
18	002242		8, 639, 276. 71	0. 99
19	600584		8, 057, 318. 91	0. 92
20	600893		7, 828, 564. 54	0. 90

7.4.3

	434, 487, 594. 08
	459, 249, 706. 96

7.5

1		26, 136, 064. 00	3. 37
2		−	−
3		208, 278, 000. 00	26. 84
		208, 278, 000. 00	26. 84

4 51

7.6

1	170210	17	10	1,400,000	138,250,000.00	17.82
2	113011			658,110	69,147,617.70	8.91
3	120415	12	15	500,000	50,020,000.00	6.45
4	1580049	15		400,000	40,968,000.00	5.28
5	1480283	14		400,000	33,764,000.00	4.35

7.7

7.8

7.9

7.10

7.10.1

7.10.2

7.11

7.11.1

7.11.2

7.11.3

7.12

7.12.1

7.12.2

7.12.3

1		140,846.94
2		17,509,054.73
3		–
4		16,138,408.98
5		–
6		1,928,200.00
7		–
8		–
9		35,716,510.65

7.12.4

					%
1	132001	14	EB	7,407,000.00	0.95
2	110032			3,564,000.00	0.46

7.12.5

				%	
1	300367		10,134,776.32	1.31	

7.12.6

8

8.1

( )					
1,577	498,310.46	695,048,278.75	88.45%	90,787,323.90	11.55%

9

2015 5 6	568,039,225.55
	885,983,493.77
	628,054.99
:	100,775,946.11
"-"	–
	785,835,602.65

10

10.1

10.2
10.2.1

10.2.2

10.3

10.4

10.5

10.6

10.7
10.7.1

	1	395, 027, 648. 78	44. 20%	328, 386. 46	47. 73%	–

	3	315, 648, 705. 15	35. 32%	262, 399. 02	38. 14%	–
	2	183, 060, 947. 11	20. 48%	97, 260. 67	14. 14%	–
	1	–	–	–	–	–
	1	–	–	–	–	–
	1	–	–	–	–	–
	1	–	–	–	–	–
	2	–	–	–	–	–
	1	–	–	–	–	–

10.7.2

	–	–	5, 000, 000. 00	1. 25%	–	–
	105, 114, 556. 31	100. 00%	389, 500, 000. 00	97. 25%	–	–
	–	–	6, 000, 000. 00	1. 50%	–	–
	–	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–	–

1

2

1998 29

2007 48

1

1

2

3

4

2

10.8

14			2017 4 1
15	2017 1		2017 4 22
16			2017 4 22
17	( )		2017 5 4
18			2017 5 12
19			2017 5 24
20			2017 5 26

21

11

11.1   20%

		20%				
	1	2017　1　1 　　2017 6　30	576,117,540.50	0.00	0.00	576,117,540.50	73.31%
	—	—	—	—	—	—	—
1						
2						
3						

11.2

12

12.1

  1

  2

  3

  4

  5

  6

12.2

12.3

2017   8   24