

2018

2018 6 30

交

2018 8 29

1

1.1

修

六

二

交

2018 8 27

中

修

二

净

不

2018 1 1

2018 6 30

1.2

§1 **2**

 1.1 2

 1.2 3

§2 **6**

 2.1 6

 2.2 6

 2.3 7

 2.4 7

 2.5

6.4	20
§7	42
7.1	42
7.2	42
7.3	43
7.4	44
7.5	信 信	47
7.6	主 信	47
7.7	48
7.8	主	48
7.9	主	48
7.10	之	48
7.11	信 之	48
7.12	49
§8 交	50
8.1	交	50
8.2	50
8.3	交	50
	交	51
§10	52
10.1	交	52
10.2	52
10.3	52
10.4	52
10.5	52
10.6	52
10.7	之	52
10.8	53
§11	57
11.1	交 20%	57

11.2	57
§12	58
12.1	58
12.2	58
12.3	58

2

2.1

	519957	
	2015 7 6	
	交	
交	391,969,885.80 交	
	A	C
:	A	C
之	519957	519956
交	5,510,035.51 交	386,459,850.29 交

2.2

	六	
1		二
	亿	
2		
1		" "
2		
		丰
3	信	
	信	
	信	

	4	信
六	300	信
		信

2.3

	021-61009999	020-87555888
	zhouyg@cxfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
	4007005566	95575
	021-61009800	020-87555129
	68 9	2 618
	68 9	183-187 43
	200120	510620

2.4

	www.cxfund.com.cn
	68 9 183-187 43

2.5



3

3.1

	A	C
3.1.1	(2018 1 1 - 2018 6 30)	(2018 1 1 - 2018 6 30)
	-477,292.62	-3,029,801.25
	-455,849.37	-5,324,315.15
交	-0.0761	-0.0291
	-9.24%	-3.73%
交	-8.48%	-9.06%
3.1.2	(2018 6 30)	
	-1,209,109.43	-97,759,633.87
交	-0.2194	-0.2530
	4,442,473.50	298,046,719.84
交	0.8063	0.7712
3.1.3	(2018 6 30)	
交	-19.37%	-22.88%

1

2

之

之

3

信

3.2

3.2.1 交

六

A

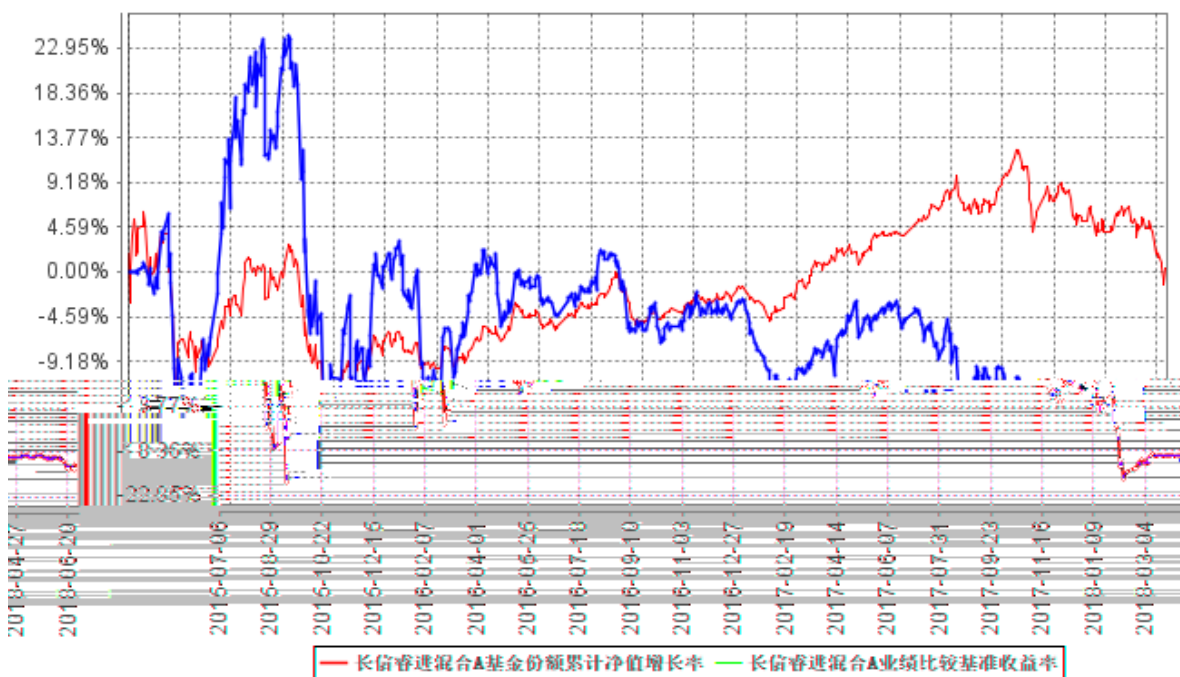
	交	交 六	六	六 六		
	-0.57%	0.37%	-4.37%	0.77%	3.80%	-0.40%
	-0.70%	0.22%	-5.19%	0.68%	4.49%	-0.46%
	-8.48%	0.70%	-6.18%	0.69%	-2.30%	0.01%
	-12.36%	0.84%	-0.68%	0.57%	-11.68%	0.27%

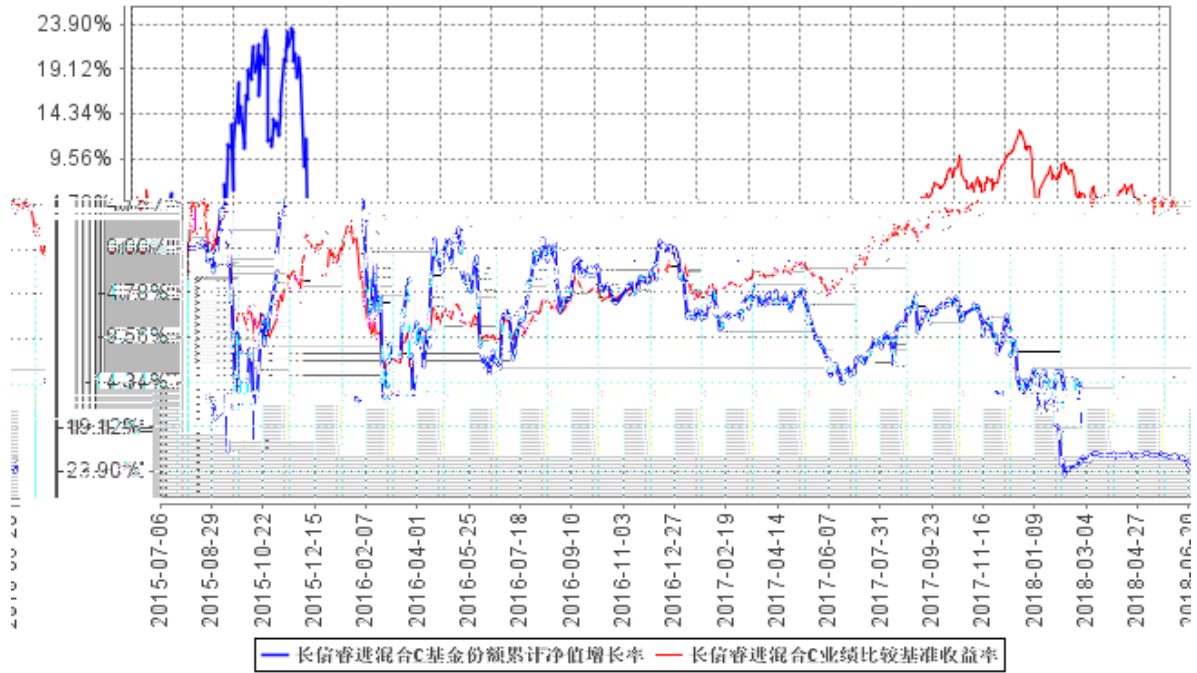
	-19.37%	1.67%	0.29%	0.88%	-19.66%	0.79%
--	---------	-------	-------	-------	---------	-------

C

	交	交 六	六	六 六		
	-0.64%	0.37%	-4.37%	0.77%	3.73%	-0.40%
	-0.87%	0.22%	-5.19%	0.68%	4.32%	-0.46%
	-9.06%	0.69%	-6.18%	0.69%	-2.88%	0.00%
	-14.31%	0.83%	-0.68%	0.57%	-13.63%	0.26%
	-22.88%	1.67%	0.29%	0.88%	-23.17%	0.79%

3.2.2 二 交 六





1 2015-07-06 2018-06-30

2

6

4

4.1

4.1.1

		2018 6 30		2017 6 30	
交	交	31.21%	15.15%	44.55%	1.65
书	交		4.54%		交
					4.55%
		2018 6 30		61	
			亿		信

六

4.2

中
交

交

二

净

交

4.3

之

4.3.1

之

之

之

之

之 净

之

之

4.3.2

之

之

之

之

之

之

5%

之

4.4

4.4.1

伦

2018

2018

二

500

信

2018

3

六

4 5 交

4 5

信

二

二

信

4.4.2

A 交

0.8063

交

0.8063

A 交

-8.48%

C 交

0.7712

交

0.7712

C 交

-9.06%

六

-6.18%

4.5

2018

中

二

信

二

信

二

信

亿

伦信

4.6

二

中

中

中

,

净

信
之 之 信 二

4.7

净二
净
1 12
3
2 A 交 C 交 交
3
4 交
5 交 六 交 其

4.8

2017 12 13 2018 3 12 主
中 2018 4 4
主

5

5.1

交

中

5.2

交

交

5.3

六

2018

中 二 六

之		-	-
		-	-
		-	-
信		-	-
信	6.4.6.8	83,398.48	210,000.09
信		7,867,544.53	515,083.64
	6.4.6.9	391,969,885.80	47,490,728.70
	6.4.6.10	-89,480,692.46	-7,023,768.29
		302,489,193.34	40,466,960.41
信		310,356,737.87	40,982,044.05

2018 6 30

A 交 0.8063

C

交 0.7712

交 391,969,885.80 交

A 交

5,510,035.51 交

C 交 386,459,850.29 交

6.2

2018 1 1 2018 6 30

		2018 1 1 2018 6 30	2017 1 1 2017 6 30
		-3,655,152.29	-134,185.84
1.		2,389,224.27	69,656.77
	6.4.6.11	85,939.46	38,811.60
信		1,576,713.06	-
		-	-
		726,571.75	30,845.17
		-	-
2.	二 -	-3,782,097.73	-9,754,821.32
	6.4.6.12	-3,602,028.73	,130,521.14
		-	-

5.	二 -	6.4.6.18	10,791.82	10,066.70
其			2,125,012.23	1,273,701.99
1		6.4.9.2.1	1,093,316.17	453,803.59
2		6.4.9.2.2	182,219.41	75,633.94
3		6.4.9.2.3	563,536.58	208,499.90
4 之		6.4.6.19	193,554.50	418,126.21
5			-	-
			-	-
6			-	-
7		6.4.6.20	92,385.57	117,638.35
	二 -		-5,780,164.52	-1,407,887.83
其			-	-
	二 -		-5,780,164.52	-1,407,887.83

6.3

2018 1 1 2018 6 30

	2018 1 1 2018 6 30		
	47,490,728.70	-7,023,768.29	40,466,960.41
	-	-5,780,164.52	-5,780,164.52
交 之			
其 二 -	344,479,157.10	-76,676,759.65	267,802,397.45
1.	359,095,783.98	-79,637,558.06	279,458,225.92
2.	-14,616,626.88	2,960,798.41	-11,655,828.47
交	-	-	-

其 二 -			
主	391,969,885.80	-89,480,692.46	302,489,193.34
	2017 1 1 2017 6 30		
	78,279,036.84	-5,687,322.33	72,591,714.51
	-	-1,407,887.83	-1,407,887.83
交 之 其 二 -	-20,526,723.53	1,491,470.24	-19,035,253.29
1.	6,089,561.40	-456,637.10	5,632,924.30
2.	-26,616,284.93	1,948,107.34	-24,668,177.59
交 其 二 -	-	-	-
主	57,752,313.31	-5,603,739.92	52,148,573.39

6.1 6.4

6.4**6.4.1**

二

二

[2015]1164

六

六

2015

7 6

308,604,154.67 交 交

交

交 A 交 C 交 A 交
C 交

信 信 六 信 信 信 信

信 信 信 信 信 信 二

二 二 0%-95% 信 信

二 5%-100%

之 3% 之

之 5%

二 信

六 300 信

6.4.2

六净 二 六净 二 二 六净 二

六净 二 六净 二

中

六净 2

净 3

XBRL 3 < >

二

6.4.3 六净

六净
中 2018 6 30 二 2018 1 1
2018 6 30

6.4.4 二

6.4.4.1

6.4.4.2

6.4.5

6.4.5.1

六 2008 4 24
之 3 1
六 2008 9 19
之

[2005]103

6.4.5.2

[2016]36
六 2016 5 1

信

[2016]70

二

信

[2016]140

二

[2017]56

2018 1 1

3%

2018 1 1

二 交

其

6.4.5.3

2011

2011

元

六

—

7%

—

3%

—

2%

6.4.5.4

[2004]78

2004 1 1

信

[2005]103

交

[2008]1

亿

信

信

6.4.5.5

[2005]103

交

[2008]132

偏

2008 10 9 偏

[2012]85

2013 1 1

1 二 1

1 二 1 1 其 50%

1 其 25% 20%

[2015]101

2015 9 8

6.4.6.2 之

		2018 6 30		
		76,600,790.01	73,490,225.69	-3,110,564.32
- 之		-	-	-
信	之	44,129,741.50	44,167,200.00	37,458.50
		124,392,660.00	124,498,000.00	105,340.00
		168,522,401.50	168,665,200.00	142,798.50
		-	-	-
		-	-	-
		-	-	-
		245,123,191.51	242,155,425.69	-2,967,765.82

6.4.6.3 / 信

/ 信

6.4.6.4

6.4.6.4.1

:

		2018 6 30		

信	1,563,958.35
	-
	24,005.60
	-
	-
	27.45
	1,593,197.66

6.4.6.6

6.4.6.7 之

	2018 6 30
之 之	80,787.33
之	4,816.27
	85,603.60

6.4.6.8 信

	2018 6 30
之	-
	12.91
	49,590.38
	24,795.19
	9,000.00
	83,398.48

6.4.6.9

A		
	2018 1 1	2018 6 30
	交 交	
	6,180,848.33	6,180,848.33
	1,184,981.65	1,184,981.65
(二"-")	-1,855,794.47	-1,855,794.47
- 交	-	-

	-97,759,633.87	9,346,503.42	-88,413,130.45
--	----------------	--------------	----------------

6.4.6.11

	2018 1 1	2018 6 30
		59,363.29
		-
		-
		10,819.11
		15,757.06
		85,939.46
530.82	15226.24	

6.4.6.12**6.4.6.12.1**

	2018 1 1	2018 6 30
之		

其 信 信 信	142,885,700.00
其	3,489,716.98
信	-360,350.00

6.4.6.13.3 信

信

6.4.6.13.4 信

信

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**

	2018 1 1	2018 6 30
		180,281.00
		-
		180,281.00

6.4.6.17

	2018 1 1	2018 6 30
1. 之		-2,273,070.65
		-2,415,869.15

信	142,798.50
	-
	-
	-
2.	-
	-
3.	-
其	-
	-2,273,070.65

6.4.6.18

	2018 1 1	2018 6 30
		10,791.38
		0.44
		10,791.82

30 交

30 3 交 75% 3

6 交 50% 6

交 25%

6.4.6.19 之

	2018 1 1	2018 6 30
之 之		190,704.50
之		2,850.00
		193,554.50

6.4.6.20

	2018 1 1	2018 6 30
		24,795.19
		49,590.38
		18,000.00
		92,385.57

6.4.7 信

6.4.7.1

信

6.4.7.2 信

六

信

6.4.8

6.4.8.1

6.4.8.2 之

	(二)
交	(二)
交	(二)

6.4.9 之

6.4.9.1 之 之

6.4.9.1.1 之

	2018 1 1		2018 6 30		2017 1 1		2017 6 30	
	之		之		之		之	
	139,780,559.76	100.00%	143,424,740.11	100.00%				

6.4.9.1.2 信 之

	2018 1 1		2018 6 30		2017 1 1		2017 6 30	
	之		信 之		之		信 之	
	54,129,741.50	100.00%	-	-	-	-	-	-

6.4.9.1.3 信 之

	2018 1 1 2018 6 30		2017 1 1 2017 6 30	
	之	信 之	之	信 之
	2,524,000,000.00	100.00%	80,000,000.00	100.00%

6.4.9.1.4 之

之 之

6.4.9.1.5

	2018 1 1 2018 6 30		2017 1 1 2017 6 30	
	130,177.47	100.00%	80,787.33	100.00%
	2017 1 1 2017 6 30			
	250,812.18	100.00%	125,791.11	100.00%

二

之 交 之 之
信 之 交

6.4.9.2

6.4.9.2.1

	2018 1 1 2018 6 30		2017 1 1 2017 6 30	
		1,093,316.17		453,803.59

C 0.80%

H

H C 交

E C 交

6.4.9.3 信 ()之

信 ()之

6.4.9.4

6.4.9.4.1

6.4.9.4.2

6.4.9.5

6.4.9.6

6.4.9.7 之

之 之 二 之

之 二

6.4.10

6.4.11 2018 6 30

6.4.11.1 /

/

中

中二

6.4.12.2

之 之

交 交

中

二

10%

10%

之 之 之

之 之

之则 二

6.4.12.2.1

信

信

6.4.12.2.2

6.4.12.2.3

	2018 6 30	2017 12 31
A-1	-	-
A-1 二	-	-
	124,498,000.00	-
	124,498,000.00	-

AA+ 二

6.4.12.2.4

信

	2018 6 30	2017 12 31
AAA	0.00	0.00
AAA 二	0.00	0.00
	44,167,200.00	0.00
	44,167,200.00	0.00

信 信

信

信

6.4.12.2.5**6.4.12.2.6****6.4.12.3**

二

二

二

之

二

6.4.12.3.1

净

之

之

之

2017	12	31					
			4,873,864.34	-	-	-	4,873,864.34
			173,588.89	-	-	-	173,588.89
			55,528.79	-	-	-	55,528.79

VaR (Value at Risk)

6 30

6.4.12.4.3.1

	2018 6 30		2017 12 31	
		%		%
之 -	73,490,225.69	24.30	35,869,764.51	88.64
之	-	-	-	-
之 信	168,665,200.00	55.76	-	-
之	-	-	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-
	242,155,425.69	80.05	35,869,764.51	88.64

6.4.12.4.3.2

修	95%			
			信	
		2018 6 30	2017 12 31	
	VaR 1.05% 2017 12 31 VaR 3.22%)			
		-3,166,534.21	-1,301,079.96	

VaR

信

6.4.13.1.2 二

6.4.13.1.2.1

2018 6 30

二

72, 124, 882. 07

170, 030, 543. 62

0. 00

6.4.13.1.2.2

之

信

之

之

之

信

信

6.4.13.1.2.3

二

6.4.13.2

信

6.4.13.3

信

7

7.1

			%
1		73,490,225.69	23.68
		73,490,225.69	23.68
2		-	-
3		168,665,200.00	54.35
	信	168,665,200.00	54.35
		-	-
4		-	-
5		-	-
6		50,000,000.00	16.11
		-	-
7		9,707,581.85	3.13
8		8,493,730.33	2.74
9		310,356,737.87	100.00

之

7.2

7.2.1

			(%)
A	元	-	-

K		2,996,669.00	0.99
L		1,812,899.13	0.60
M		-	-
N		727,636.00	0.24
O		-	-
P		-	-
Q		-	-
R		3,504,760.00	1.16
S		-	-
		73,490,225.69	24.30

7.2.2

之

7.3

1	603883		27,200	2,261,952.00	0.75
2	603019		49,000	2,247,630.00	0.74
3	002815		136,900	2,204,090.00	0.73
4	300166		143,700	2,116,701.00	0.70

21	002390		224,700	1,644,804.00	0.54
22	000002		66,800	1,643,280.00	0.54
23	600729		48,500	1,598,075.00	0.53
24	002440	交	132,800	1,552,432.00	0.51
25	000333		29,400	1,535,268.00	0.51
26	600426		86,300	1,518,017.00	0.50
27	600585		45,100	1,509,948.00	0.50
28	300383		109,600	1,469,736.00	0.49
29	002268		67,164	1,466,190.12	0.48
30	300182	交	189,000	1,432,620.00	0.47
31	600673		137,800	1,423,474.00	0.47
32	000703		95,211	1,416,739.68	0.47
33	601155		43,700	1,353,389.00	0.45
34	002491		121,043	1,339,946.01	0.44
35	002422	仍	41,700	1,338,570.00	0.44
36	002410		47,100	1,306,083.00	0.43
37	300287		169,600	1,219,424.00	0.40
38	002311		55,400	1,168,940.00	0.39
39	600346	交	79,300	1,162,538.00	0.38
40	600566		23,600	1,137,284.00	0.38
41	600195	交	57,700	1,122,265.00	0.37
42	002078		98,600	955,434.00	0.32
43	300253		66,700	826,413.00	0.27
44	000860	元	21,000	787,500.00	0.26
45	300266		36,400	727,636.00	0.24
46	000729		94,742	637,613.66	0.21
47	600600		11,500	504,045.00	0.17
48	300324		39,138	371,419.62	0.12
49	600410		36,200	316,750.00	0.10
50	002359		13,600	266,288.00	0.09

7.4

7.4.1

2% 20

1	600460		2,710,998.09	6.70
2	603883		2,240,453.00	5.54

3	603019		2,229,347.00	5.51
4	002428		2,220,495.00	5.49
5	002815		2,212,325.00	5.47
6	002179		2,178,602.47	5.38
7	002223		2,161,560.00	5.34
8	000975		2,145,430.36	5.30
9	300166		2,130,254.00	5.26
10	600521		2,125,134.80	5.25
11	000651		1,983,455.00	4.90
12	000681		1,983,396.00	4.90
13	600754	交	1,964,517.00	4.85
14	002032		1,879,042.50	4.64
15	601155		1,875,960.00	4.64
16	600967		1,869,285.52	4.62
17	002127		1,866,823.83	4.61
18	002268		1,862,796.28	4.60
19	002390		1,843,526.00	4.56
20	002332		1,813,515.85	4.48
21	000002		1,805,812.00	4.46
22	002371		1,802,841.00	4.46
23	000066		1,786,756.00	4.42
24	002440	交	1,779,466.00	4.40
25	000977		1,730,426.70	4.28
26	600729		1,686,226.28	4.17
27	000333		1,634,030.00	4.04
28	600585		1,626,194.00	4.02
29	000860	元	1,621,301.00	4.01
30	300182	交	1,584,032.00	3.91
31	600426		1,576,485.00	3.90
32	300383		1,537,232.00	3.80
33	002422	仍	1,491,813.00	3.69
34	000703		1,482,985.48	3.66
35	002491		1,476,215.93	3.65
36	300287		1,463,711.00	3.62
37	002311		1,428,404.00	3.53
38	600673		1,405,675.00	3.47

39	002410		1,350,205.02	3.34
40	600346	交	1,252,978.84	3.10
41	600566		1,185,753.00	2.93
42	000732		1,181,128.00	2.92
43	000656	交	1,150,306.00	2.84
44	600195	交	1,138,890.00	2.81
45	002078		1,042,158.00	2.58
46	300409		872,250.00	2.16

之 之 二 之 之

7.4.2

2% 20

1	300015		1,557,311.00	3.85
2	300498	交	1,407,513.40	3.48
3	300316		1,293,226.00	3.20
4	300296		1,293,224.00	3.20
5	300251		1,227,270.00	3.03
6	300182	交	1,202,722.90	2.97
7	300003		1,168,277.00	2.89
8	300347		1,155,826.00	2.86
9	000656	交	1,138,881.00	2.81
10	300009		1,105,241.00	2.73
11	300122		1,098,697.20	2.72
12	000732		1,078,058.00	2.66
13	300124		1,040,358.00	2.57
14	300144		1,031,738.00	2.55
15	300197		1,013,506.00	2.50
16	300274		1,010,578.00	2.50
17	300070		1,009,683.00	2.50
18	300618		993,124.50	2.45
19	300136		964,066.00	2.38
20	300463		929,005.00	2.30
21	300098		908,748.00	2.25
22	300088		894,517.00	2.21
23	300408		885,729.00	2.19
24	300459		874,998.00	2.16

25	000860	元	870,342.00	2.15
26	300203		863,446.00	2.13
27	300055		851,351.00	2.10
28	300083		849,941.00	2.10
29	300072		843,710.00	2.08
30	300433		837,136.00	2.07
31	300355		831,760.00	2.06

之 之 二 之 之

7.4.3

之	91,709,459.41
之	48,071,100.35

之 之 之 之

之 二 之 之

7.5 信 信



4	111813043	18	CD043	300,000	28,698,000.00	9.49
---	-----------	----	-------	---------	---------------	------

7.7

7.8

主

7.9

主

7.10

之

7.10.1

7.10.2

7.11

信 之

7.11.1 信

信

7.11.2

信

信

7.11.3 信

信

7.12**7.12.1****7.12.2****7.12.3**

1		67,784.09
2		6,828,745.89
3		-
4		1,593,197.66
5		4,002.69
6		-
7		-
8		-
9		8,493,730.33

7.12.4

信

信

7.12.5**7.12.6**

主

8 交

8.1 交

交 交

交	()	交				
			交	交	交	交
A	509	10,825.22	0.00	0.00%	5,510,035.51	100.00%
C	3,873	99,783.08	0.00	0.00%	386,459,850.29	100.00%
	4,382	89,450.00	0.00	0.00%	391,969,885.80	100.00%

8.2

	交	交 交	交
	A	0.00	0.00%
	C	2,570.69	0.00%
		2,570.69	0.00%

8.3

交

	交	交 交
	A	0
	C	0
		0
	A	0
	C	0
		0

9 交

交

	A	C
2015 7 6 交	34,971,320.32	273,632,834.35
交	6,180,848.33	41,309,880.37
交	1,184,981.65	357,910,802.33
其: 交	1,855,794.47	12,760,832.41
交 交 其 二"-"	-	-
交	5,510,035.51	386,459,850.29

10

10.1 交

交

10.2

10.3

10.4

10.5

10.6

10.7 之

10.7.1 之

	之	之		之		
		之	之			
	2	139,780,559.76	100.00%	130,177.47	100.00%	-
	1	-	-	-	-	-
	1	-	-	-	-	-
	1	-	-	-	-	-

	1	-	-	-	-	-
	1	-	-	-	-	-

10.7.2 之

	信 之		信 之		之	
	之	信 之	之	信 之	之	之
	54,129,741.50	100.00%	2,524,000,000.00	100.00%	-	-
	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-

1	2017 12 31		2018 1 1
2			2018 1 4
3			2018 1 5
4			2018 1 16
5	2017 4		2018 1 20
6			2018 2 1
7		亿	2018 2 2
8			2018 2 6
9			2018 2 7
10			2018 2 10
11		不 2018 1	2018 2 14
12			2018 3 17

13

	之 交		
	亿		
17			2018 3 29
	亿		
18	2017		2018 3 31
19			2018 4 18
20	2018 1		2018 4 20
21			2018 4 21
22			2018 4 23
23			2018 4 27
24	亿		2018 5 7
25			2018 5 8
26	交		2018 5 17
	亿		
27	交		2018 5 21
28			2018 5 21
29			2018 5 21
30			2018 5 28

	亿		
31			2018 5 31
32			2018 6 7
33			2018 6 15
34			2018 6 20
35			2018 6 22
36			2018 6 28
37	亿 亿 之 交		2018 6 30
38	2018 6 30		2018 6 30

11

11.1

交

20%

交

20%

11.2

12

12.1

- 1 六
- 2
- 3 不
- 4
- 5