2012 12
19 2012 1708
2013 2 4
3 2016 2 4
LOF
LOF 2016 2 5
2016 2 5
LOF 2016 6 24 ,
LOF C
LOF C A LOF A

3 A
B

.....1
.....2
.....7
.....19
.....24
.....36
.....41
.....42
主 A 43
.....45
.....62
.....64
.....67
.....76
.....80
.....84
.....86
.....93
主 96
.....98
.....99
.....106
..... 111
.....114
.....143
.....166
.....169
.....173
主 仔 174

亲

仔

	LOF
	仔
	2003 10 28 2004 6 1
	2011 6 9 10 1
	2004 6 8 7 1
	2004 6 29 7 1
	3 A B 7 3
A	A A 6
B	B B

	3 A B B B
A	A 6
	3 A 6 T
A	A A 1.0000
B	3 2013 1 1 3 2016 1 1
3	3 2013 1 1 3 2016 1 1 3 B
3	3 LOF LOF
LOF A	
LOF C	京
	B LOF
	仔
	仟
	仔

	仔

	仔
	3 A A A 10% 3 LOF 10%
	京

	主　　主
	买
	仔 仔

	68 9
	68 9
	200120
	[2003]63
	2003 5 9
	021-61009999
	021-61009800

		7350	49%
		5149.5	34.33%
		2500.5	16.67%
		15000	100%

2017 2 8

京 1.5 1.65

44.55%

31.21% 15.15%

4.55% 4.54%

1

			EMBA

			，
			仟 /
			EMBA
			EMBA 京 2002

			( )

2

3

			京 2001
			京 CIM Investors Group Financial Services Co. Ltd 2002 LOF
			京 仔

4

2016 11 30

		12	2013 LOF

5

	LOF
	100
	件
	LOF)
	FOF 买 LOF
1	

2 2017 3 8 3 2017 3 18

	FOF
	180 2017 2 4

1

2

3

8

9

10

11

12

仔

13

14

15

16 七

17

书

18

19

20

21

22 15

23

24

25 京

26

27

28

29

30

1 七

2

1 京

2

3

4

5

3

1

2

3

4

京

1

1

2

3

4

2

1

2

3

4

5 买

买

6

七

7

8

9

10

11

3

1

2

3

仔 仔

京

4

5

七

4

5

1

2

3

4

5

6

7

8

6

1

2 买 买

京

3

4

京

5

6

7

7

1

2

12

12

1992 10 19

186.53

[2003]105

021 61618888

2003

2003 2005

2013 2016 件

仟

1955

1965

1966

仟

仟

2016 6 30 1029.49
, 19.90% ,
18 LOF
件 LOF

件 仟

REITs

1 七

2

3 :

京

件

件

七

仔

/

1

七

1

2

3

4

5

6

2

七

3

1

2

3

4

1

2 仔

书

3

1	
68 9	
68 9	
021-61009916	021-61009917
400-700-5566	www.cxfund.com.cn
2	
1	
69	
69	
010-85109219	
95599	www.abchina.com
2	
25	
1 1	
010-67596084	
:95533	www.ccb.com
3	
188	
188	
021-58781234	021-58408483
95559	www.bankcomm.com
4	
7088	
7088	
0755-83198888	0755-83195109
95555	www.cmbchina.com

5	
12	
12	
021-61618888	021-63604199
95528	www.spdb.com.cn
6	
8 C	
8 C	
010-65558888	
95558	bank.ecitic.com
7	
46	
46	
	七
0571-85108195	0571-85106576
96523 400-8888-508	www.hzbank.com.cn
8	
1099	
1099	
0755-22166118	0755-25841098
95511-3	bank.pingan.com
9	
4018 35 28 A02	
4018 35 28 A02	
0755-82558305	0755-28558355
4008-001-001	www.essence.com.cn
10	
8	
8	
举	
027-65799999	027-85481900
95579 4008-888-999	www.95579.com

11	
24	
129 39	
0411-39673202	0411-39673219
4008-169-169	www.daton.com.cn
12	
510 9	
500 26	
021-68761616	021-68767032
400-8888-128	www.tebon.com.cn
13	
115 20	
115 18	
0755-23838751	0755-25831754
95358	www.firstcapital.com.cn
14	
5	
5	
0512-62938521	0512-65588021
400 860 1555	www.dwzq.com.cn
15	
1508	
1508	
021-22169999	021-22169134
95525	www.ebscn.com
16	
5 19 20	
5 19 20	
020-88836999	020-88836654
020-961303	www.gzs.com.cn

17	
157 7 8	
157 7 10	
0591-87383623	0591-87383610
96326 0591	www.hfzq.com.cn
18	
183 43	
183 43	
020-87555888	020-87557985
95575	www.gf.com.cn
19	
3 9 10	
3 9 10	
010-84183389	010-84183311-3389
400-818-8118	www.guodu.com
20	
95	
95	
028-86690057 028-86690058	028-86690126
95310	www.gjzq.com.cn
21	
168	
8 702	
0510-82831662	0510-82830162
95570	www.glsc.com.cn
22	
88	
88	
0791-86283080	0791-86288690
4008-222-111	www.gsstock.com

23	
618	
168	29
95521	021-38670666
4008888666	www.gtja.com
24	
1012	
1012	

29	
638 21	
638	
0931-4890208	0931-4890628
4006898888	www.hlzqgs.com.cn
30	
56	
56	
0451-82336863	0451-82287211
400-666-2288	www.jhzq.com.cn
31	
1619 A 41	
1619 A 41	
0791-86768681	0791-86770178
400-8866-567	www.avicsec.com
32	
8	
8 518048	
0755-22626391	0755-82400862
95511 8	www.stock.pingan.com
33	
86	
86	
0531-68889155	0531-68889752
95538	www.qlzq.com.cn
34	
336	
336	
021-53519888	021-53519888
4008918918 021-962518	www.962518.com

35	
989 45	
989 40	
021-33389888	021-33388224
95523 4008895523	www.swhysc.com
36	
:	2
	2
027-87618882	027-87618863
028-86711410	www.tfzq.com
37	
19 B 701	
28 C 5	
010-66045529	010-66045518
010-66045678	www.txsec.com
38	
101	
118 仟 24	
021-36533017	021-36533017
400-8811-177	www.xzsec.com
39	
18	
1 11	
010-83991743	010-66412537
010-83991888	www.rxzq.com.cn
40	
268	
1199 . 1 21	
021-38565785	
400-8888-123	www.xyzq.com.cn

41	
38-45	
38-45	
0755-82960223	0755-82943121
95565 400-8888-111	www.newone.com.cn
42	
35 仟 C	
35 仟 C	
010-66568888	010-66568990
4008-888-888	www.chinastock.com.cn
43	
66 4	
: 188	
010-85130588	010-65182261
400-8888-108	www.csc108.com
44	

8 仟

47	
9 1	
9 1	
010-63081000	010-63080978
95321	www.cindasc.com
48	
8	
8	
023-63786633	023-63786212
4008096096	www.swsc.com.cn
49	
1218 1 202	
B 6	
0571-81137494	4000-766-123
4000-766-123	www.fund123.cn
50	
526 2 220	
555 B 16	
021-20691832	021-20691861
400-820-2899	www.erichfund.com
51	
7650 205	
68 8 801	
021-38602377	021-38509777
400-821-5399	www.noah-fund.com
52	
685 37 4 449	
1118 903-906	
021-58870011	021-68596916
4007009665	www.ehowbuy.com
53	

22 10	
22 10	
021-68419822	021-20835779
400-920-0022	www.licaike.com
54	
190 2 2	
195 3C 7	
021-54509998	021-64385308
400-1818-188	fund.eastmoney.com
55	
88 9 15 1809	
88 SOHO C 1809	
010-52855713	010-85894285
4006099400	www.yixinfund.com
56	
1 903	
7 2 2	
0571-88911818	0571-86800423
4008-773-772	www.5ifund.com
57	
100 19	
100 19	
021-33323999-5611	021-33323830
4008202819	www.chinapnr.com
58	
1333 14 09	
1333 14	
021-20665952	021-22066653
4008219031	www.lufunds.com
59	

359 B 4 A506	
1386 15	
021-22267943	021-22268089
400-928-2266	www.dtfortune.com
60	
277 3 310	
518 8 3	
021-52822063	021-52975270
400-046-6788	www.66zichan.com
61	
1217 16 B	
1217 6	
021-80133597	021-80133413
4008081016	www.fundhaiyin.com
62	
765 602-115	
1 4	
021-80365020	021-63332523
4006433389	www.lingxianfund.com
63	
5475 1033	
91 61 10 12	
86-021-50583533	86-021-50583633
400-921-7755	http://a.leadfund.com.cn/
64	
6 105 -3451	
1 12 B1201-1203	
020-89629012	020-89629011
020-89629066	www.yingmi.cn
65	

11 11 1108	
11 11 1108	
18001102931	010-62680827
400-619-9059	www.fundzone.cn
3	
http://www.szse.cn	

	17	256 1405	1 2 8
	17	256 1405	1266 50
	010-59378856	021-51150298	021-22122888
	010-59378907	021-51150398	021-62881889

7 3

A B

3 A B

1 A B

3 A 6

A

6 A

A 6

12

B B

3

2 A

A

A 1.0000 A

A

A

3

A B

A B 7 3 3

A

A 1.0000 A

T+1

A 书 A

A B

A

A 1.2 1 +1.0%

A

2

1 A

A

1 A

1 A

1

1 2.5%

5% 1 2.5% 1-5% =2.375%

件 A A

B A

书 A 享

A

A

A 享

A B

T T /T

3 T A

B 3 LOF

T LOF

4 5

T T+1

A B

3

A B

A A

1 A

3 A t ta

A t A

t NVt t Fat t A

NAVa t A r A

t

T A NAVaT T A r A

T A

A

1 T 1.00 T A

T A

$$NAV_{aT} = 1.00 \times \left(1 + \frac{r}{\quad} \times T_a\right)$$

T A

T A $F_{aT} \times 1.00 \times \frac{r}{\quad} \times T_a$

A T A

2) T 1.00 T A

T A

$$NAV_{aT} = \frac{NV_T}{F_{aT}}$$

2 B

NAVbT T B FbT T B

B

$$NAV_{bT} = \frac{NV_T - NAV_{aT} \times F_{aT}}{F_{bT}}$$

A B 8

9

A B

3 A

A B A A

B

B 3 A B

2012 12 19

2012 1708

A 2013 1 28 2013 1 29 B

2013 1 21 2013 1 25

1.00

695,708,650.10 A 487,013,434.87

B 208,695,215.23 6,745

仔

2013 2 4 京

200

5000

20 200 20 5000

京

A

3 A

A

3 A T

6

A

T

T A

A

3 6

A 1.0000

A

A

A T A 1.0000

A A A

A

A A

B

1 2

2 2

3 A

A B

3

LOF

A

1 A

4

京

5 A

书

4

1

A

A

书

2

T T+1 A

T 2

3

T+1 A

书 A

A A

A

A

A

A A

4

T 7 ( )

5

1 A 1

1

2 A 1

1

1

3

4

6 A

1 A

A 1.0000

2

A

1.0000

=

= -

2 A

3 A

1 A

A A 0.15%

A 0

A 100%

7

A

A T+1

A

T+1

书

3

8

A

A

1

2

3

4

京

5

6

7

5 6

9

A

A

1

2

3 A

10

4

5

书

10

1

A

A 10%

2

1

2

10%

3

2

3

3

1

LOF 30

2

买

LOF 2016 2 18

2

2

3

1

2

3

4

5

书

4

1

书

2

T T+1

T+2

3

T 7 ( )

5

1 1

1

2 100

100

3

1

1

4

5

6

6

1 LOF

LOF

A C LOF A

LOF LOF A

A

M	
M 100	0.8%
100 M 500	0.5%
M 500	1000

M

B

Y	
Y 3	0.3%
3 Y<6	0.15%
6 Y 1	0.1%
Y 1	0

2 LOF C

A

LOF LOF C

0.10%

B

LOF LOF C

90	0.10%
90 90	0

2 A B LOF

C A B LOF C

0.10%

25%

2

3

1 LOF A

LOF A LOF A

= / 1

= -

= /

2 LOF C LOF C =

LOF A C

2

LOF C

2 T

T

2

2

4

T T T

T T+1

4 5

7

T+1

T+2

T+1

书

3

8

1

2

3

4

京

5

6

1 5

9

1

2

3

4 2 2

5

书

4

20

书

10

1

10%

2

1

2

10%

件

3

2

3

2 ( )

20

11

1

2 1 2

1

3 1 2 2

1

4 2

2 LOF

1

1

2

3

2

1

2

仔

仔

仔

享

仔

B

3 LOF

B B

B

3 LOF

B 2013 4 26

B 150102 2016 2 4

3

LOF

LOF 45

LOF 163005 2016 3 11

3

1 B

2 LOF

3 10%

4 100

5 0.001

6

( )

3 B

( )

3 B

3 B

( )

3 B

B 2016 2 4

: 2± UîÊB‡ÌÙ Ô$ø!’ C¡C!“œ° ”`°EÔ#0

3

LOF

LOF A B

LOF 2016 6 24

LOF C A

LOF 享

LOF A

A

3 A

LOF

A LOF

3 A

A

3 B

LOF

1

3

3

2

LOF

1.0000 1.0000

A B

LOF

A B A

B /1.0000

A B LOF

A B A

B

A B

LOF B

LOF 享

A B A

B LOF

3

A B LOF 45

3 LOF

3 A B

A

七

京 仟

仟

仟

仟

京

80% 20%

5%

A B

1

仟

件

件

2

京

今

今

七

2

4 仟

仟 仟

京

仟 10%

1-3

5

6

京

1

2

仟 仟

仔

A B

1

2

3

4

1

2

3

4

5

6

7

8

9

2

10%

3 10%

4

5

0.5% 3%

10%

京

6

40%

1

7

10%

8 20%

9 ( )

10%

10

10%

11 BBB (BBB)

3 书

12

七

13 仟 10%

14

15

京

京

1

2

3 京

4

5

6

7 京

8

2016 12 31 2016 4

			%
1		-	-
		-	-
2		-	-
3		1,108,590,465.84	82.95
		1,108,590,465.84	82.95
		-	-
4		-	-
5		-	-
6		174,055,981.08	13.02
		-	-
7		21,504,189.33	1.61
8		32,225,531.24	2.41
9		1,336,376,167.49	100.00

1

2

			%
1		19,974,000.00	1.50
2		-	-
3		30,000,000.00	2.25
		30,000,000.00	2.25
4	仟	1,008,097,438.44	75.61
5	仟	-	-
6		50,384,000.00	3.78
7		135,027.40	0.01
8		-	-
9		-	-
10		1,108,590,465.84	83.14

					%
1	1480130	13 02	500,000	54,035,000.00	4.05
2	1480032	13 02	500,000	53,375,000.00	4.00
3	1580025	15	500,000	52,625,000.00	3.95
4	1480463	14	500,000	52,335,000.00	3.93
5	1380388	13	600,000	51,750,000.00	3.88

主

1

2

3

1

2

3

1		58,161.15
2		-

3		-
4		32,117,259.09
5		50,111.00
6		-
7		-
8		-
9		32,225,531.24

4

			( )	%
1	113008		135,027.40	0.01

5

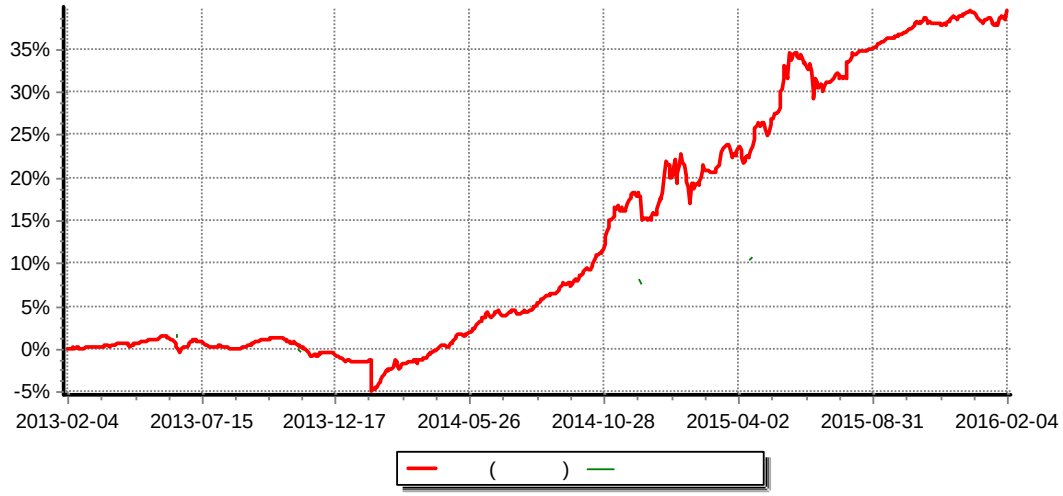
6

亲

1

2013 2 4 2013 12 31	-1.40%	0.11%	-4.19%	0.09%	2.79%	0.02%
2014 1 1 -2014 12 31	19.95%	0.36%	6.54%	0.11%	13.41%	0.25%
2015 1 1 -2015 1 31	17.66%	0.48%	4.19%	0.08%	13.47%	0.40%
2016 1 1 -2016 2 4	-1.57%	0.32%	-0.07%	0.10%	-1.50%	0.22%

2



1 2013 2 4 2013 2 4 2016 2 4

2 6

1

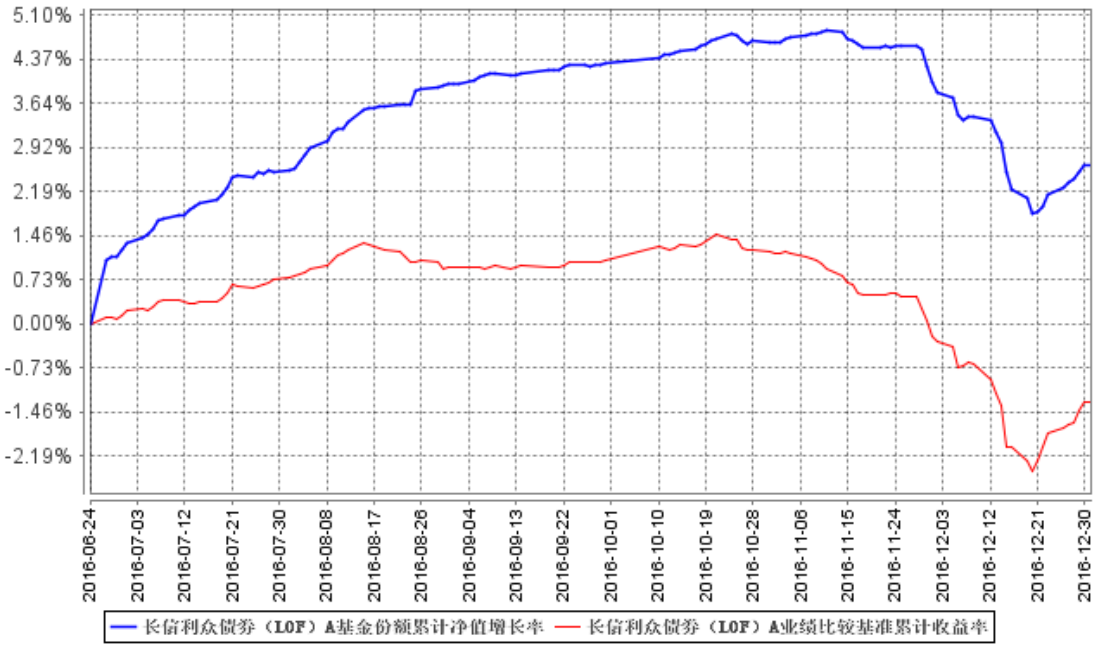
LOF A

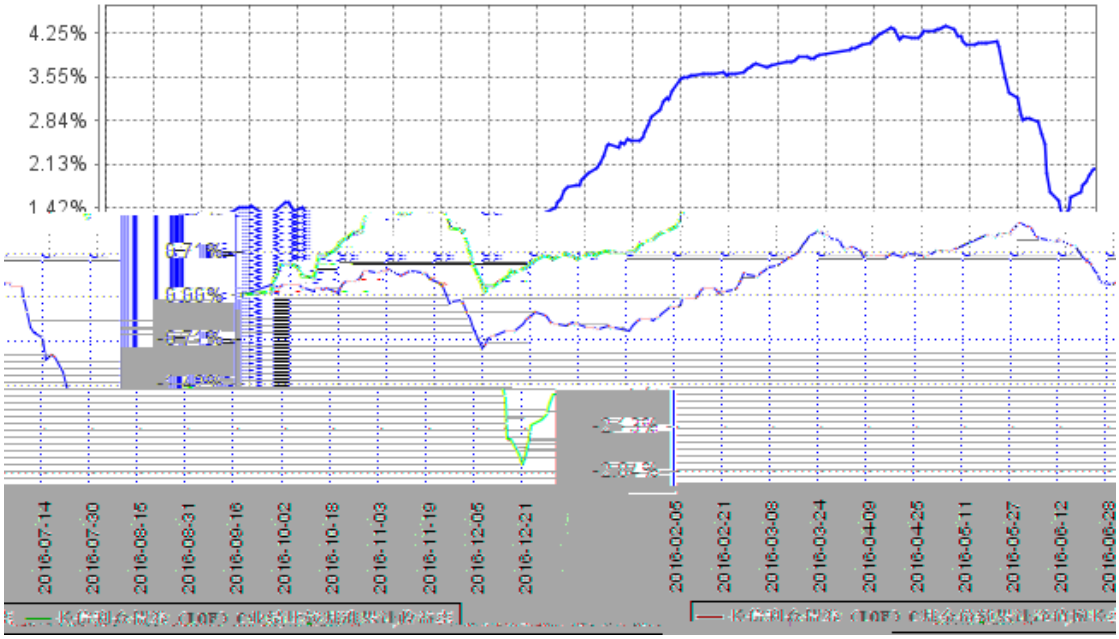
2016 6 24 -2016 6 30	0.20%	0.04%	0.14%	0.06%	0.06%	-0.02%
2016 7 1 -2016 9 30	3.06%	0.05%	0.91%	0.05%	2.15%	0.00%
2016 10 1 -2016 12 31	-1.61%	0.12%	-2.32%	0.15%	0.71%	-0.03%

LOF C

2016 2 5 -2016 6 30	1.24%	0.08%	-0.14%	0.06%	1.38%	0.02%
2016 7 1 -2016 9 30	2.62%	0.05%	0.91%	0.05%	1.71%	0.00%
2016 10 1 -2016 12 31	-1.76%	0.12%	-2.32%	0.15%	0.56%	-0.03%

2 /





1 2016 6 24 LOF

C A

2 LOF A 2016 6 24 2016 12

31 LOF A

3 2016 2 5 LOF C 2016 2

5 2016 12 31 ,

4 6

2013 2 4 2016 2 5 ,

买

1

仔

仔

2

1

2

3

3

1

享

书

A B

/

书

1

书

享

2

1

2

3

享

4

5

6

7

3

1

2

3

4

4

1 4 4

书

0.25%

0.5%

2

1

2

3

4

3

4 京

1

2

3

4

5

1 3

7 4

2

1

2

3

4

5

6

7

8

9

10

京

京

1

0.70%

0.70%

H

H

E

3 京

3

3

2

0.20%

0.20%

H E

H

E

3 京

3

3

3

LOF A LOF C

0.35%

LOF C LOF C

0.35%

H

H LOF C

E LOF C

3 京

3

3

4 4 9

京

京

京

1 3

3

京

2 LOF

1

2 仔

12 10%

3

4

5

15

6

7 京

1

2 15

3 京

1

2 1 1 12 31

3

4

5

6

7

1 京

买

2

3

书

1

2

3

4

5

6

1

3

1

6

45

15

2

仔

3

仔

2

3

4

3

5

A B

A B

A B

A B

A B

A B

3 LOF

6

仔

7

90

60

15

2

2

3 A

A B

8

仔 2

书

仔

仔

1

2

3

4

5

6

7

8

9 50%

10

30%

11

12

13 七

七

14

15

16

17 0.5%

18

19

20

21 A

22 A

23 A

24 3

25 3

LOF

26

27

28

29

30

9

10

书 30

11 仟

仟

仟

仔 仟

12

A A

B

仔

仔

仔 仔

仔

( )

1

2

3

4

5

1

1

2

京

3

仟

4

京

5

京

2

仟 仟

仟

3

4

买

京

5

仟

6

7

IT

8

9

10

1 A

1

A 1

A A

A

京

2

A 6

A

A A

3

3 A

A

4

A A

A

5

3 LOF

A

LOF

A LOF

A LOF

2 B

1

A 1

A A

B 京

2

3 A

B B B

B

B

3

B B

B

B

B

B

京

4

A B 7 3 A

B 7 3

B A

6 A

A A B

B

5 /

B 3 B

B B

B

京 /

6

3 LOF

B

LOF B

B

3 仟

仟

仟 仟

长信基金
Chang Xin Asset Management

1

1 30

2 京

3

2

1

2

3

4

5

6

7

8

9

10

11

3

件 京

4

1

2

3

4

1 3

3

件 A

B

2 LOF

3 LOF

1 3

5

2

6 仔

仔 15

1

68 9

68 9

200120

2003 5 9

[2003]63

1.5

2

1

2

3

4

5

6

7

8

9 仔

10

7

8

仔

A B /

3 A

9

10

11 七

12

书

13

14

15

16

15

17 仔

仔 仔

18 ,

19

20

21

22

23

24 仔

30

25

26

27

3

12

689

1992 10 19

[

2

3

4

5

6

7

1

2

3

买

买

4

5

6 ,

7

书

8 A

B /

3 A

9

10

七

11 15

12

13

14

15

16

17

18

19

20

21

22

5

仔

3 A B

3 LOF

1

2

3

4

5

6

7

8

9

1

2

3

4

5

6 京

7

8

9

1

1 3

A B A B

2 3

LOF

2

1

1

2 3

LOF

3

4

5

6

7

8

9

10 10% 10%

3

10% 10%

A B 10%

10%

11

12

2

1

10

60 享

4 10%

10

60

10% 享

10

60

5 10%

10%

30

4

1

30

1

2

3

4

5

6

7

8

9 仔

10

2

3

5

1

1

2

3

4

2 仔

1

仔 东

		50%	50%
	3	A	

6

1

1

2 10%

10%

35

30

30

3

4 10% 10%

6

5

30

30

2

1

50%

50% 3 A B

50% 50% 东

2

30

2

3

3

7 仔

1

3 A B

A B

2

1

50%

50% 3 A

B 50% 50%

2

3

4 书

2

书

9

1

5

2

3 2

4

1

2

3

1 3

3

京

2 LOF

1

2 仔 12

10%

3

4

5

15

6

7 京

4

5

1

2 15

8

9

10

京

2

京

3

1

0.70%

0.70%

H

H

E

3 京

3

3

2

0.20%

0.20%

H

H

E

3 京

3

3

3

A C

0.35%

C C 0.35%

H

H C

E C

3 京

3

3

4 1 4 9

京

1

仟

仟

仟

京

80% 20%

5%

2

京

1

2

3 京

4

5

6

7 京

8

3

1 80%

20%

5%

2

10%

3 10%

4

5

0.5%

3% 10%

京

6

40%

1

7

10%

8

20%

9 ( )

10%

10

10%

11 BBB (BBB)

3 书

12

10%

5%

13 仟

10%

14

15

京

1

2

1

1

2

3 1 2

1 2

4

2

1

2

3 仟

4

5

6

7 1 6

1 6

8

3

1 京

2

3

4 1 3

1 3

5

4

享 书

3

A B

A B

A B

8

9

2

1

2 6

3

3

1

1 30

2 京

3

2

1

2

3

4

5

6

7

8

9

10

11

3

件 京

4

1

2

3

4

3

3

件 A

B

LOF

3 LOF

1 3

5

2

6 仔

仔 15

京

主

1

68 9

68 9

200120

2003 5 9

[2003]63

1.5

2

12

689

1992 10 19

[2003]105

186.53

QFII

仟

仟

1

仟

仟

仟

京

80% 20%

5%

2

1

2

1 80%

20%

5%

2

10%(

)

3 10%

4

5

0.5% 3%

10%

京

6

40%

1

7

10%

8 20%

9 ( )

10%

10

10%(

)

11 BBB (BBB)

3 书

12

10%

5%

13 仟 10%

14

15

京

3

10

京

4

5

6

买

3

京

1

2

3 京

4

5

6

7 京

8

京

买

京

享

4

七

享

3

享

书

书

5

仔

仔

6

1

2

，

3

4

仔

5

7

1

2

，

，

，

，

，

，

，

8

仟

仟

仟

仟

仟

仔

仟

仟 京

，仟

仟

，

9

A B

A A B

10

，

，

东

1

A B

A A B A

2

七 享

1

1

2

3

3

1

2

3

4

1

′

2

3

4 仔

5

书 买

6 京

5

6

1 京

2 京

7

8

仔

9

仔

15

仔 仔

1

1

3

A B /

b

c

d

2

3

京

4

享 书

3

1 4 4

书

0.25%

0.5%

2

1

2

3

4

3

4 京

4

1

2

3

京

仔 仔

8

1

2

,

3

5

15

45

60

90

1

1

2

3 A

4 B

5

6

7

2

3

3

15

书

京

1

2

1

2

3

4

			T 2 5
			仔 / / 仔
			T+2 /

1

			5 ,
			400-700-5566 www.cxfund.com.cn 仔 (service@cxfund.com.cn) 仔 (021-61009865)
			仔
			东
			400-700-5566 www.cxfund.com.cn
			仔

主			4007005566 8 30-12 00 13:00-17:00
			021-61009865
			http://www.cxfund.com.cn
			service@cxfund.com.cn

1	LOF		2016/8/6
2	LOF A 件		2016/8/10
3	件		2016/8/18
4	LOF C		2016/8/19
5	LOF 2016		2016/8/22
6	件		2016/8/24
7	(LOF) 2016		2016/8/26
8	件		2016/9/1
9	件		2016/9/1
10	件		2016/9/12
11	LOF 2016 2		2016/9/14

12	件		2016/9/20
13			2016/10/14
14			2016/10/19
15	(LOF)2016 3		2016/10/24
16	件		2016/10/27
17	件		2016/10/27
18			2016/11/15
19	2016		2016/11/23
20			2016/11/23
21			2016/11/24
22	件		2016/11/29
23	LOF)		2016/11/30
24			2016/12/1
25	件		2016/12/6

26			2016/12/6
27			2016/12/17
28			2016/12/20
29			2016/12/21
30	件		2016/12/22
31	LOF		2016/12/22
32			2016/12/27
33	件		2016/12/29
34	件		2016/12/29
35			2016/12/30
36	件		2017/1/12
37			2017/1/13
38			2017/1/14
39			2017/1/17
40			2017/1/17

41	(LOF)2016 4		2017/1/21
2017 2 4			

仔　　仔　　仔

仔

仔

仔

仔

仔

仔

仔