

2017 1

< 份
<

不

2015 6 11

2015 1212

后 2015 8 17

团 团
后

<团 团

因

A

= B

			份
			份 关 份 关 关 关
具			关份 份 关 东 ()
<p><</p> <p>1 =</p> <p>2 2017 3 22 刚充 份 不<刚充 份 2007 6</p> <p>东 =2011 12 份 =2016 1 份 =2016 4 份 =</p> <p>3 2017 3 22 主 份</p>			

2

			关 份 东 份 份
充			份 份 东 份 东 东 东 东 东
			关 份 东 份 份
			关 份 份 份 份
			关 份 份 份 份
			关 份 份 份 份

<

4

		份	
		后	东 2010 7 份 份 份东 LOF 东 值 东 值
		2015 8 26	三 东 份 2015 6 份 份 FOF 五 (LOF)
1		=	
2	2017 3 18	份	

5 况

况	
	况 份
	况 值 值 值 值 值

< 183-187 43 4301-4316

< 183-187 5 7 8

18 19 38 39 40 41 42 43 44

<

<1994 1 21

双 < 2014 510

< 7,621,087,664 充

<

<

<020-87555888

1991 2010

2015 双 <

000776.SZ 1776.HK 2016 6 30 关 20

东 264 东 31

不

LME

东 东

2016 6 30 76.21 充 3,576.09

充 735.99 充=2016 1-6 东

101.30 充 40.30 充 双

东 则

东

东 东

变 东

2012 5 份
 <1984 8 1990 8 份
 份 双 份 1990 8 1994 9 份
 1994 9 1996 3 份 1994 7 1995
 7 份 1996 3 2000 6 份
 份 2000 6
 2003 3 份 关 2003 9
 2006 1 份 2006 1 2007 4
 份 份 2007 4 2011 3 份
 份 2015 3 份
 1984 7 变 住
 住 1997 8 变 住
 住
 2014 5 份
 <1991 7 1993 8 份 1993 8 1994
 6 份 1994 7 1998 1 份
 东 1998 1 2004 3 份 东 2004
 3 2004 10 份 东 东
 2004 10 2005 3 份 2005 3 2005
 9 份 2005 10 2008 12 份
 2009 1 2014 9 份 后
 2009 10 2012 11 份 双 2011 9 2011
 12 份 东 2015 8 份
 五 1988 6 住
 住 1991 7 住 关
 住 2013 5 变
 住双 2003 12 变 住 住
 刚 份
 刚 2000 7 2003

7

住

3

东

2014 5 变

依

2016 12

东

100

800

50

因

16 召

1

东

东

=

=

双

双

后

=

东

2

东

东

=

东

=

东

东

东 住

3

双

下

1	<	份	
	<	68	9
	<	68	9
	<		<
	<021-61009916		<021-61009917
	<400-700-5566		<www.cxfund.com.cn
2			
1			
	<	188	
	<	188	
	<		<
	<021-58781234		<021-58408483
	<95559		<www.bankcomm.com
2			
	<	12	
	<	12	
	<		<
	<021-61618888		<021-63604199
	<95528		<www.spdb.com.cn
3			
	<	2	
	<	2	
	<		<
	<010-58560666		<010-57092611
	<95568		<www.cmbc.com.cn
4			
	<	1099	
	<	1099	
	<		<
	<0755-22166118		<0755-25841098
	<95511-3		<bank.pingan.com
5			
	<	8	
	<	8	

<	<
<027-65799999	<027-85481900
<95579 4008-888-999	<www.95579.com
6 东	
< 115 20	
< 115 18	
<刚	<
<0755-23838751	<0755-25831754
<95358	<www.firstcapital.com.cn
7	
< 东 5	
< 东 5	
<	<
<0512-62938521	<0512-65588021
<400 860 1555	<www.dwzq.com.cn
8	
< 1508	
< 1508	
<	<刚
<021-22169999	<021-22169134
<95525	<www.ebscn.com
9 份	
< 157 7 8	
< 157 7 10	
<	<
<0591-87383623	<0591-87383610
<96326 0591	<www.hfzq.com.cn
10	
< 183 43	
< 183 43	
<	<
<020-87555888 东	<020-87557985
<95575 东	<www.gf.com.cn
11	
< 3 9 10	
< 3 9 10	
<	<
<010-84183389	<010-84183311-3389

<400-818-8118		<www.guodu.com	
12			
<		95	
<		95	
<		<刚	
<028-86690057 028-86690058		<028-86690126	
<95310		<www.gjzq.com.cn	
13			
<		618	
<		168	29
<		<	
<95521		<021-38670666	
<4008888666		<www.gtja.com	
14			
<		198	
<		959	B1
<		<	
<0551-5161666		<0551-5161600	
<96518 400-80-96518		<www.hazq.com	
15			
份			
<		100	57
<		100	57
<		<刚	
<021-68777222		<021-68777822	
<400-820-9898		<www.cnhbstock.com	
16			
<		638	21
<		638	
<		<	
<0931-4890208		<0931-4890628	
<4006898888		<www.hlzqgs.com.cn	
17			
<		56	
<		56	
<		<	
<0451-82336863		<0451-82287211	
<400-666-2288		<www.jhzq.com.cn	



< 28 C 5	
< 之	
<010-66045529	<010-66045518
<010-66045678	<www.txsec.com
25	
< 101	
< 118 东 24	
<	
<021-36533017	<021-36533017
<400-8811-177	<www.xzsec.com
26 东	
< 268	
< 1199 . 1 21	
<	
<021-38565785	
<400-8888-123	<www.xyzq.com.cn
27	
< 38-45	
< 38-45	
<	
<0755-82960223	<0755-82943121
<95565 400-8888-111	<www.newone.com.cn
28	
< 35 2-6	
< 35 东 C	
< 关	
<010-66568292	<010-66568990
<4008-888-888	<www.chinastock.com.cn
29	
< 66 4	
: 188	
<	
<010-85130588	<010-65182261
<400-8888-108	<www.csc108.com
30	
< 下 8 单	
< 48	
<	



37				
<	不	7650	205	
<		68		8 801
<				<
<021-38602377		<021-38509777		
<400-821-5399		<www.noah-fund.com		
38				
<		685	37 4	449
<		1118		903-906
<				<
<021-58870011		<021-68596916		
<4007009665		<www.ehowbuy.com		
39				
<		22		10
<		22		

<	1333	14	09	南充
<	1333	14		
<				<
<021-20665952				<021-22066653
< 4008219031				<www.lufunds.com
44				
<	359		B	4 A506
<	1386	15		
<				<
<021-22267943				<021-22268089
<400-928-2266				<www.dtfortune.com
45				
<		277	3	310
<	518	8	3	
<				<
<021-52822063				<021-52975270
<400-046-6788				< www.66zichan.com
46				
<	1217	16	B	南充
<	1217	6		
< 刚				<
<021-80133597				<021-80133413
<4008081016				< www.fundhaiyin.com
47				
<	765	602-115		
<	1	4		
<				<
<021-80365020				<021-63332523
<4006433389				<www.lingxianfund.com
48				
<	5475	1033		
<	91	61	10	12
<				<
<86-021-50583533				<86-021-50583633
<400-921-7755				<http://a.leadfund.com.cn/
49				
<	6	105	-3491	
<	1		12	B1201-1203

<	<
<020-89629012	<020-89629011
<020-89629066	<www.yingmi.cn
50	
<	11 11 1108
<	11 11 1108
<	<七
<18001102931	<010-62680827
<400-619-9059	<www.fundzone.cn
3	
<http://www.sse.com.cn	南

双

1

85% 95%

85%

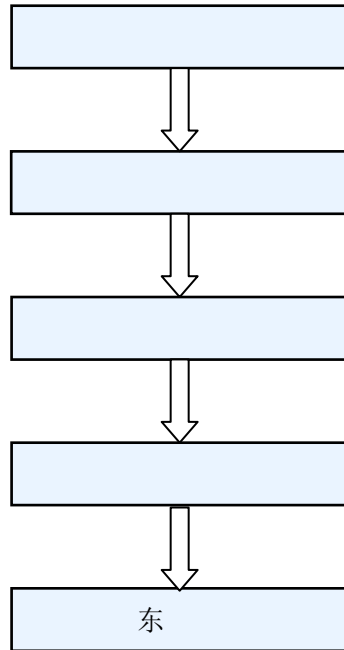
80%

不 会

2

双

不 <
<



不<

1

事

东

0.35%

变

则

<

$$S_e = \sqrt{\frac{\sum_{t=1}^T (e_t - \bar{e})^2}{T-1}}$$

e_t

$$e_t = R_{p_t} - R_{t_t} = R_{p_t}$$

R_{t_t}

=T

2

双 下

双

=

团

=

3

双

因

4

东

后

5

东

3 值

团 值 不 值 值

值

4

事 住

也 东

95% -5%

世

值 5% 团 东 95%

-5%

东 东 东 双

后 东 东 双

东 双

东

东

(

)

后 后 变

值 = A

= B

双 双 份

后

2016 12 31 2016

则

		充	%
1		17,089,525.52	88.45
	<	17,089,525.52	88.45
2		-	-
3		-	-
	<值	-	-
		-	-
4		-	-
5		-	-
6		-	-
	< 因	-	-
7		2,043,301.10	10.58

8		188,736.37	0.98
9		19,321,562.99	100.00

<

东

1

东

1

东

	东	元 充	(%)
A	东	-	-
B	东	1,792,360.91	9.50
C	东	7,705,622.38	40.84
D	东 双 依	87,514.00	0.46

下 元

1 元

南住< 充

				元 充	
1	601668		86,314	764,742.04	4.05
2	601669		80,609	585,221.34	3.10
3	601727		67,500	573,075.00	3.04
4	600028		103,693	560,979.13	2.97
5	601989		76,695	543,767.55	2.88
6	601390		59,598	528,038.28	2.80
7	000063		32,332	515,695.40	2.73
8	601186		42,960	513,801.60	2.72
9	601857		61,096	485,713.20	2.57
10	002202		27,576	471,825.36	2.50

2 元

值 值

值

元

值

值

元

元

六 元

也

1

2

值

1 值

值

2

值

值

3 值

值

1

2

后

3

		充
1		12,224.61
2		-

3		-
4		383.24
5		176,128.52
6		-
7		-
8		-
9		188,736.37

4 值

值

5

1

			元 (充)	%	
1	601727		573,075.00	3.04	

2

6

团

东

东

停 况

2016 12 31 双

后

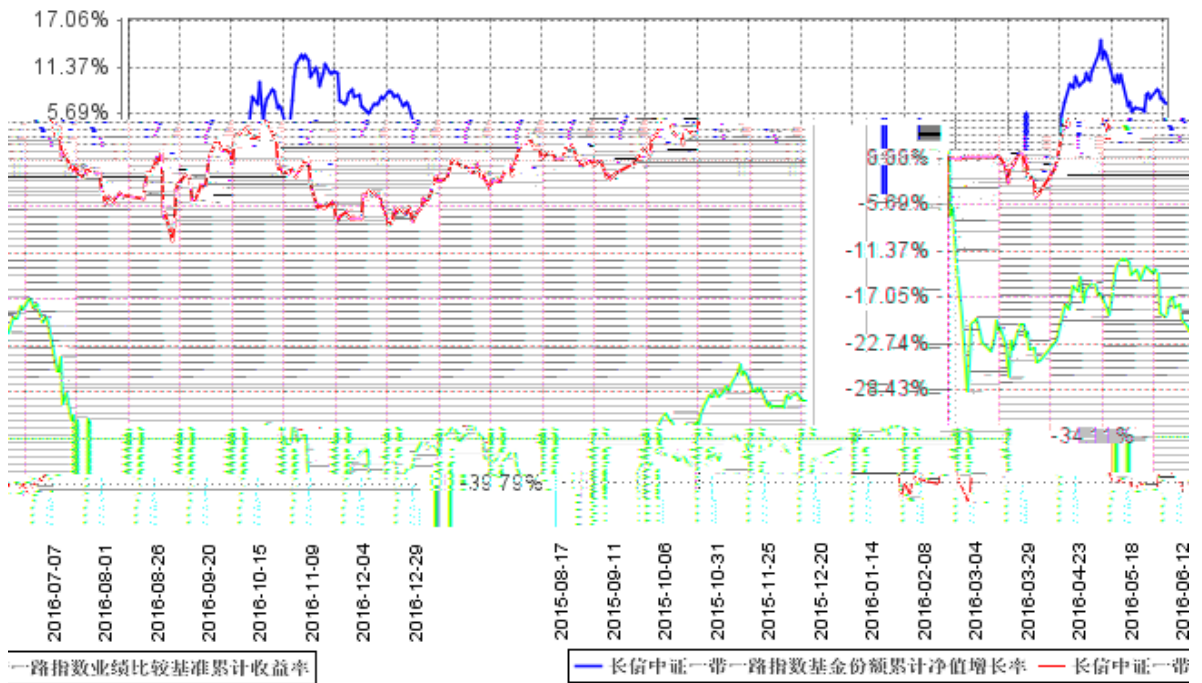
东

<

			东	东	-	-
2015 8 17	6.70%	1.33%	-19.83%	2.52%	26.53%	-1.19%

2015 12 31						
2016 1 1 -2016 6 30	-10.86%	1.58%	-24.00%	2.24%	13.14%	-0.66%
2016 7 1 -2016 9 30	3.50%	0.82%	4.16%	0.87%	-0.66%	-0.05%
2016 10 1 -2016 12 31	8.51%	1.09%	11.02%	1.13%	-2.51%	-0.04%

后 2016 12 31
东 <



<1 2015 8 17 2016 12 31
 2 后 后 6
 =
 后

下

1

1.00%

不<

H 1.00

H

E

5

2

0.22%

不<

H 0.22

H

E

5

变

3 后

双

双

后

不<

0.02%

不<

H E 0.02%

H

E

后

变

不 后 不
变不 5 三充

()

1

1

南

不<

M	
M 100 三	1.2%
100 三 M 200 三	0.8%
200 三 M	1000 充

<M

2

2 因

因 0.50%

因 因

因 变 因 25%

关

双

不<

