

合

[2009]1409

2017 10 1 -2017 12 31

2009 6 30

: 438,731,183.66

2017 10 1 -2017 12 31

1	集合计划本期利润	-2,334.30
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	8,973.70
3	单位集合计划净收益	-0.001
4	期末集合计划资产总值	2,848,844.09
5	期末集合计划资产净值	2,385,775.93
6	单位集合计划资产净值	1.015
7	本期集合计划净值增长率	-0.1%
8	集合计划累计净值增长率	35.00%

1

2

3

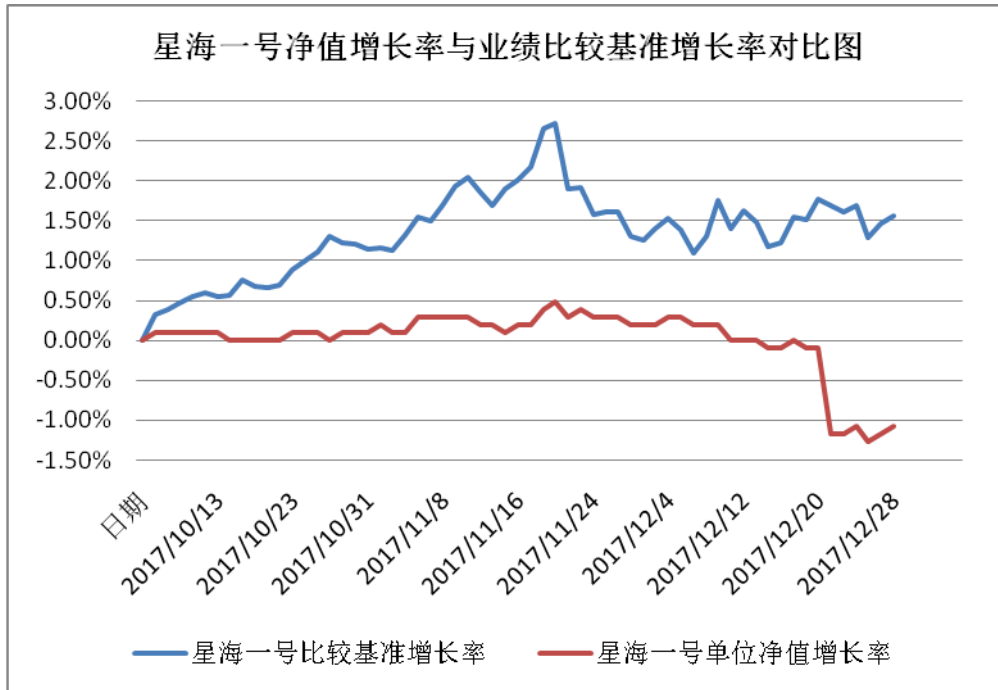
[

-

-1] 100%

4

1 100%



2017 12 31

1.015

-0.1%

1.350

35.00%

2017		1.25%	0.42%
0.09%	6.12%	50	7.04%
	50		
	11		
		11	
3450.49			
		11	16
			3254.18
3250-3350	18		
			10
			11

2017			
	GDP	6.8%	CPI
1.6%	PPI	6.3%	

300
2017 12 31
-0.1%

75%*
1.55%

+25%*
1.350

2

2018
6.6%

GDP

2018
2.4%

PPI 3%
CPI 3.1%

2018

A

IPO

17

A

1 2017 12 31

:

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资产：		负债：	
银行存款	300,452.89	短期借款	
结算备付金	24,666.55	交易性金融负债	
存出保证金	114	衍生金融负债	
交易性金融资产	514,550	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	217,460	应付证券清算款	
债券投资	297,090	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	2,031.92
基金投资		应付托管费	406.38
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产	2,000,000	应付交易费用	320.38
应收证券清算款	3,014.79	应付税费	

应收利息	6,045.86	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	460,309.48
其他资产		负债合计	463,068.16
		所有者权益：	
		实收基金	2,350,180.39
		未分配利润	35,595.54
		所有者权益合计	2,385,775.93
资产合计：	2,848,844.09	负债与持有人权益总计：	2,848,844.09

2

2017 10 1 -2017 12 31

：

项目	本期金额	本年累计金额
一、收入	10,752.70	87,804.05
1、利息收入	28,612.69	120,699.04
其中：存款利息收入	3,336.98	10,935.45
债券利息收入	10,009.88	33,887.15
资产支持证券利息收入	0.00	
买入返售金融资产收入	15,265.83	75,876.44
2、投资收益（损失以“-”填列）	-6,551.96	-7,554.50
其中：股票投资收益	190.00	3,530
债券投资收益	-6,741.96	-11,084.50
资产支持证券投资收益	0.00	
基金投资收益	0.00	
权证投资收益	0.00	
衍生工具收益	0.00	
股票基金红利收益	0.00	
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-11,308.03	-25,340.49
4、其他收入（损失以“-”填列）	0.00	
二、费用	13,087.03	57,675.68
1、管理人报酬	6,176.46	29,125.74

2、托管费	1,235.33	5,825.16
3、销售服务费	0.00	
4、交易费用	128.95	333.25
5、利息支出	0.00	
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	
6、其他费用	5,546.29	22,391.53
三、利润总额	-2,334.33	30,128.37

2017 12 31

1

:

项目	期末市值	占总资产比例
银行存款、清算备付金、存出保证金、 应收清算款合计	328,248.23	11.52%
股票	217,460	7.63%
债券及资产证券化	297,090	10.43%
证券投资基金	0.00	0.00%
其他资产	2,006,045.86	70.42%
资产总值	2,848,844.09	100.00%

2

序号	债券代码	债券名称	期末市值（元）	占资产净值比例（%）
1	124999	13 武续债	154,200.00	6.46
2	122071	11 海航 02	142,890.00	5.99

势

期初总份额	本期红利再投资份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总额
2,634,762.72	15,417.67	0.00	300,000.00	2,350,180.39

1

[2008]1409

2

3

4

129

3811

www.estock.com.cn

4008-169-169