

2

全 入 低

2

[2013]496

—

具

升

2017 4 1 -2017 6 30

2

2013 3 15

1,082,929,905.06

10

中

2017 4 1 -2017 6 30

升

1	集合计划本期利润	3,320,626.30
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	5,180,031.90
3	期末集合计划资产总值	463,845,763.43
4	期末集合计划资产净值	389,144,422.12

2017 6 30 升 冲 1.074278 全 2

A 02 升 冲 1.017397 2 A 03 升 冲 1.008011

2 A 05 升 冲 1.002652 2 A 06 升 冲 1.018641

2 A 07 升 冲 1.005184 2 C 升 冲 22.979607

中

与 一

告

中

中 低

1

10

3.01%

3.69%

70 东 BP

2.64%

100 东 BP

4

5

6

6

及

6

亿

冲

3000

冲

又

又

1244

4

升

又

1300

具

冲

2

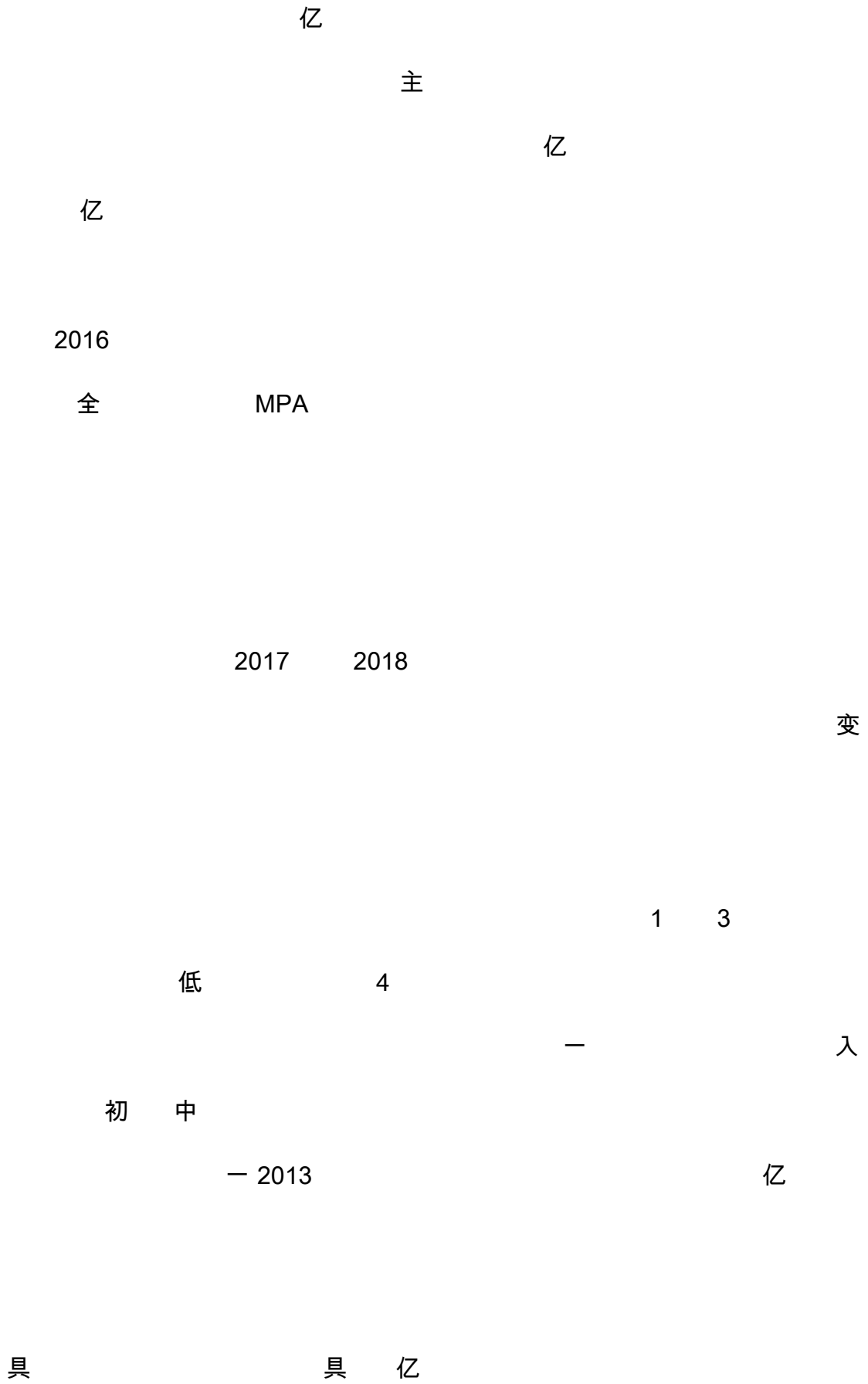
2017

具

力

具





东

了

1

2017 6 30

升：

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	355,595.35	短期借款	
结算备付金	4,473,190.03	交易性金融负债	
存出保证金	5,550.71	衍生金融负债	
交易性金融资产	443,482,007.80	卖出回购金融资产款	74,500,000.00
其中：股票投资		应付证券清算款	42,618.17
债券投资	443,482,007.80	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	79,394.64
基金投资		应付托管费	89,888.58
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	15,529,419.54	应付利息	-28,412.11
应收股利		应付利润	

应收申购款		其他负债	17,852.03
其他资产		<b>负债合计</b>	74,701,341.31
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	362,238,045.00
		未分配利润	26,906,377.12
		<b>所有者权益合计</b>	389,144,422.12
<b>资产合计：</b>	<b>463,845,763.43</b>	<b>负债与持有人权益总计：</b>	<b>463,845,763.43</b>

2

2017 4 1 -2017 6 30

升：

项目	本期金额	本年累计金额
一、收入	4,991,158.19	9,760,116.95
1、利息收入	6,762,721.85	13,725,312.71
其中：存款利息收入	21,513.75	69,178.58
债券利息收入	6,741,208.10	13,619,294.66
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产收入		36,839.47
2、投资收益（损失以“-”填列）	87,841.94	-799,021.77
其中：股票投资收益		
债券投资收益	87,841.94	-799,021.77
资产支持证券投资收益		
基金投资收益		
权证投资收益		
衍生工具收益		
股利收益		
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-1,859,405.60	-3,166,173.99
4、其他收入（损失以“-”填列）		

二、费用	1,670,531.89	3,489,630.52
1、管理人报酬	898,886.94	1,823,543.71
2、托管费	89,888.58	182,354.01
3、销售服务费		
4、交易费用	154.78	179.38
5、利息支出	668,126.26	1,445,958.19
其中：卖出回购金融资产支出	668,126.26	1,445,958.19
6、其他费用	13,475.33	37,595.23
三、利润总额	3,320,626.30	6,270,486.43

2017 6 30

1

升：

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	4,834,336.09	1.04%
股票	0.00	0.00%
债券及资产证券化	443,482,007.80	95.61%
证券投资基金	0.00	0.00%
其他资产	15,529,419.54	3.35%
资产总值	463,845,763.43	100.00%

全

2 冲 了

序号	债券名称	期末市值（元）	占资产净值比例
1	09 咸城投	33,450,840.00	8.60%
2	16 泰豪 01	33,317,060.00	8.56%



3	12 钦开投	32,576,000.00	8.37%
4	13 瑞水泥	31,280,000.00	8.04%
5	16 华讯 01	30,000,000.00	7.71%

及

升

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
366,103,045.00	119,582,000.00	123,447,000.00	362,238,045.00

升 今 何

入

低

2017 6 9

中

及

1

2

[2013]496

2

2

3

2

4

129

3811

[www.estock.com.cn](http://www.estock.com.cn)

4008-169-169

了