

招商中证白酒指数分级证券投资基金

2015 第四季度报告

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告截止日期:2016年12月31日

1.1 重要提示
基金管理人招商基金管理有限公司承诺本报告所载内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

1.2 基金产品概况
基金名称:招商中证白酒指数分级
场内简称:白酒分级
基金代码:161720

1.3 主要财务指标
1.3.1 主要财务指标
1.3.2 基金份额净值
1.3.3 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.4 基金管理人承诺
1.4.1 基金管理人承诺
1.4.2 基金管理人承诺

1.5 基金业绩
1.5.1 基金业绩
1.5.2 基金业绩

1.6 基金管理人承诺
1.6.1 基金管理人承诺
1.6.2 基金管理人承诺

1.7 基金管理人承诺
1.7.1 基金管理人承诺
1.7.2 基金管理人承诺

1.8 基金管理人承诺
1.8.1 基金管理人承诺
1.8.2 基金管理人承诺

1.9 基金管理人承诺
1.9.1 基金管理人承诺
1.9.2 基金管理人承诺

1.10 基金管理人承诺
1.10.1 基金管理人承诺
1.10.2 基金管理人承诺

1.11 基金管理人承诺
1.11.1 基金管理人承诺
1.11.2 基金管理人承诺

1.12 基金管理人承诺
1.12.1 基金管理人承诺
1.12.2 基金管理人承诺

1.13 基金管理人承诺
1.13.1 基金管理人承诺
1.13.2 基金管理人承诺

1.14 基金管理人承诺
1.14.1 基金管理人承诺
1.14.2 基金管理人承诺

1.15 基金管理人承诺
1.15.1 基金管理人承诺
1.15.2 基金管理人承诺

1.16 基金管理人承诺
1.16.1 基金管理人承诺
1.16.2 基金管理人承诺

1.17 基金管理人承诺
1.17.1 基金管理人承诺
1.17.2 基金管理人承诺

1.18 基金管理人承诺
1.18.1 基金管理人承诺
1.18.2 基金管理人承诺

1.19 基金管理人承诺
1.19.1 基金管理人承诺
1.19.2 基金管理人承诺

1.20 基金管理人承诺
1.20.1 基金管理人承诺
1.20.2 基金管理人承诺

1.21 基金管理人承诺
1.21.1 基金管理人承诺
1.21.2 基金管理人承诺

1.22 基金管理人承诺
1.22.1 基金管理人承诺
1.22.2 基金管理人承诺

1.23 基金管理人承诺
1.23.1 基金管理人承诺
1.23.2 基金管理人承诺

1.24 基金管理人承诺
1.24.1 基金管理人承诺
1.24.2 基金管理人承诺

1.25 基金管理人承诺
1.25.1 基金管理人承诺
1.25.2 基金管理人承诺

1.26 基金管理人承诺
1.26.1 基金管理人承诺
1.26.2 基金管理人承诺

1.27 基金管理人承诺
1.27.1 基金管理人承诺
1.27.2 基金管理人承诺

1.28 基金管理人承诺
1.28.1 基金管理人承诺
1.28.2 基金管理人承诺

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	500,832,680.06	93.25
2	固定收益投资	500,832,680.06	93.25
3	其中:债券	-	-
4	其中:股票	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:买入返售金融资产	-	-
7	其中:银行存款和结算备付金合计	31,218,870.10	5.81
8	其他资产	6,038,206.77	0.94
9	合计	537,089,756.92	100.00

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	制造业	500,832,680.06	94.60
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发性零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	国防军工、管理和其他服务业	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
R	合计	500,832,680.06	94.60

1.1 主要财务指标
1.1.1 主要财务指标
1.1.2 主要财务指标

1.2 基金业绩
1.2.1 基金业绩
1.2.2 基金业绩

1.3 基金管理人承诺
1.3.1 基金管理人承诺
1.3.2 基金管理人承诺

1.4 基金管理人承诺
1.4.1 基金管理人承诺
1.4.2 基金管理人承诺

1.5 基金管理人承诺
1.5.1 基金管理人承诺
1.5.2 基金管理人承诺

1.6 基金管理人承诺
1.6.1 基金管理人承诺
1.6.2 基金管理人承诺

1.7 基金管理人承诺
1.7.1 基金管理人承诺
1.7.2 基金管理人承诺

1.8 基金管理人承诺
1.8.1 基金管理人承诺
1.8.2 基金管理人承诺

1.9 基金管理人承诺
1.9.1 基金管理人承诺
1.9.2 基金管理人承诺

1.10 基金管理人承诺
1.10.1 基金管理人承诺
1.10.2 基金管理人承诺

1.11 基金管理人承诺
1.11.1 基金管理人承诺
1.11.2 基金管理人承诺

1.12 基金管理人承诺
1.12.1 基金管理人承诺
1.12.2 基金管理人承诺

1.13 基金管理人承诺
1.13.1 基金管理人承诺
1.13.2 基金管理人承诺

1.14 基金管理人承诺
1.14.1 基金管理人承诺
1.14.2 基金管理人承诺

1.15 基金管理人承诺
1.15.1 基金管理人承诺
1.15.2 基金管理人承诺

1.16 基金管理人承诺
1.16.1 基金管理人承诺
1.16.2 基金管理人承诺

1.17 基金管理人承诺
1.17.1 基金管理人承诺
1.17.2 基金管理人承诺

1.18 基金管理人承诺
1.18.1 基金管理人承诺
1.18.2 基金管理人承诺

1.19 基金管理人承诺
1.19.1 基金管理人承诺
1.19.2 基金管理人承诺

1.20 基金管理人承诺
1.20.1 基金管理人承诺
1.20.2 基金管理人承诺

1.21 基金管理人承诺
1.21.1 基金管理人承诺
1.21.2 基金管理人承诺

1.22 基金管理人承诺
1.22.1 基金管理人承诺
1.22.2 基金管理人承诺

招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金

2015 第四季度报告

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告截止日期:2016年12月31日

1.1 重要提示
基金管理人招商基金管理有限公司承诺本报告所载内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

1.2 基金产品概况
基金名称:招商中证大宗商品股票指数分级
场内简称:大宗分级
基金代码:161715

1.3 主要财务指标
1.3.1 主要财务指标
1.3.2 基金份额净值
1.3.3 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.4 基金管理人承诺
1.4.1 基金管理人承诺
1.4.2 基金管理人承诺

1.5 基金业绩
1.5.1 基金业绩
1.5.2 基金业绩

1.6 基金管理人承诺
1.6.1 基金管理人承诺
1.6.2 基金管理人承诺

1.7 基金管理人承诺
1.7.1 基金管理人承诺
1.7.2 基金管理人承诺

1.8 基金管理人承诺
1.8.1 基金管理人承诺
1.8.2 基金管理人承诺

1.9 基金管理人承诺
1.9.1 基金管理人承诺
1.9.2 基金管理人承诺

1.10 基金管理人承诺
1.10.1 基金管理人承诺
1.10.2 基金管理人承诺

1.11 基金管理人承诺
1.11.1 基金管理人承诺
1.11.2 基金管理人承诺

1.12 基金管理人承诺
1.12.1 基金管理人承诺
1.12.2 基金管理人承诺

1.13 基金管理人承诺
1.13.1 基金管理人承诺
1.13.2 基金管理人承诺

1.14 基金管理人承诺
1.14.1 基金管理人承诺
1.14.2 基金管理人承诺

1.15 基金管理人承诺
1.15.1 基金管理人承诺
1.15.2 基金管理人承诺

1.16 基金管理人承诺
1.16.1 基金管理人承诺
1.16.2 基金管理人承诺

1.17 基金管理人承诺
1.17.1 基金管理人承诺
1.17.2 基金管理人承诺

1.18 基金管理人承诺
1.18.1 基金管理人承诺
1.18.2 基金管理人承诺

1.19 基金管理人承诺
1.19.1 基金管理人承诺
1.19.2 基金管理人承诺

1.20 基金管理人承诺
1.20.1 基金管理人承诺
1.20.2 基金管理人承诺

1.21 基金管理人承诺
1.21.1 基金管理人承诺
1.21.2 基金管理人承诺

1.22 基金管理人承诺
1.22.1 基金管理人承诺
1.22.2 基金管理人承诺

1.23 基金管理人承诺
1.23.1 基金管理人承诺
1.23.2 基金管理人承诺

1.24 基金管理人承诺
1.24.1 基金管理人承诺
1.24.2 基金管理人承诺

1.25 基金管理人承诺
1.25.1 基金管理人承诺
1.25.2 基金管理人承诺

1.26 基金管理人承诺
1.26.1 基金管理人承诺
1.26.2 基金管理人承诺

1.27 基金管理人承诺
1.27.1 基金管理人承诺
1.27.2 基金管理人承诺

1.28 基金管理人承诺
1.28.1 基金管理人承诺
1.28.2 基金管理人承诺

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	11,028,109.04	3.65
B	制造业	174,707,526.62	55.48
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发性零售业	6,616,475.20	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	国防军工、管理和其他服务业	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	3,147,942.00	0.98
R	合计	181,492,052.86	59.81

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000076	广发银行	226,480	3,988,312.00	1.23
2	000099	招商证券	148,033	3,116,126.04	1.07
3	000029	盐湖钾肥	146,111	3,408,261.25	1.17
4	002428	中钢国际	107,126	3,397,422.28	1.04
5	000500	中润资源	141,168	3,213,212.96	1.01
6	000060	中金黄金	258,281	3,203,484.41	1.00
7	600773	东方钨业	320,279	3,203,643.01	1.00
8	600176	东江环保	127,748	3,246,076.68	0.99
9	000063	神华能源	618,697	3,221,856.66	0.99
10	000523	瀚蓝环保	349,047	3,222,444.96	0.99

1.1 主要财务指标
1.1.1 主要财务指标
1.1.2 主要财务指标

1.2 基金业绩
1.2.1 基金业绩
1.2.2 基金业绩

1.3 基金管理人承诺
1.3.1 基金管理人承诺
1.3.2 基金管理人承诺

1.4 基金管理人承诺
1.4.1 基金管理人承诺
1.4.2 基金管理人承诺

1.5 基金管理人承诺
1.5.1 基金管理人承诺
1.5.2 基金管理人承诺

1.6 基金管理人承诺
1.6.1 基金管理人承诺
1.6.2 基金管理人承诺

1.7 基金管理人承诺
1.7.1 基金管理人承诺
1.7.2 基金管理人承诺

1.8 基金管理人承诺
1.8.1 基金管理人承诺
1.8.2 基金管理人承诺

1.9 基金管理人承诺
1.9.1 基金管理人承诺
1.9.2 基金管理人承诺

1.10 基金管理人承诺
1.10.1 基金管理人承诺
1.10.2 基金管理人承诺

1.11 基金管理人承诺
1.11.1 基金管理人承诺
1.11.2 基金管理人承诺

1.12 基金管理人承诺
1.12.1 基金管理人承诺
1.12.2 基金管理人承诺

1.13 基金管理人承诺
1.13.1 基金管理人承诺
1.13.2 基金管理人承诺

1.14 基金管理人承诺
1.14.1 基金管理人承诺
1.14.2 基金管理人承诺

1.15 基金管理人承诺
1.15.1 基金管理人承诺
1.15.2 基金管理人承诺

1.16 基金管理人承诺
1.16.1 基金管理人承诺
1.16.2 基金管理人承诺

1.17 基金管理人承诺
1.17.1 基金管理人承诺
1.17.2 基金管理人承诺

1.18 基金管理人承诺
1.18.1 基金管理人承诺
1.18.2 基金管理人承诺

1.19 基金管理人承诺
1.19.1 基金管理人承诺
1.19.2 基金管理人承诺

1.20 基金管理人承诺
1.20.1 基金管理人承诺
1.20.2 基金管理人承诺

1.21 基金管理人承诺
1.21.1 基金管理人承诺
1.21.2 基金管理人承诺

1.22 基金管理人承诺
1.22.1 基金管理人承诺
1.22.2 基金管理人承诺

招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金

2015 第四季度报告

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告截止日期:2016年12月31日

1.1 重要提示
基金管理人招商基金管理有限公司承诺本报告所载内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

1.2 基金产品概况
基金名称:招商中证全指证券公司指数分级
场内简称:券商分级
基金代码:161722

1.3 主要财务指标
1.3.1 主要财务指标
1.3.2 基金份额净值
1.3.3 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.4 基金管理人承诺
1.4.1 基金管理人承诺
1.4.2 基金管理人承诺

1.5 基金业绩
1.5.1 基金业绩
1.5.2 基金业绩

1.6 基金管理人承诺
1.6.1 基金管理人承诺
1.6.2 基金管理人承诺

1.7 基金管理人承诺
1.7.1 基金管理人承诺
1.7.2 基金管理人承诺

1.8 基金管理人承诺
1.8.1 基金管理人承诺
1.8.2 基金管理人承诺

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,211,866,889.62	87.21
2	其中:股票	3,211,866,889.62	87.21
3	其中:债券	-	-
4	其中:基金	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	32,114,546.52	0.29
8	其他资产	126,900,684.86	3.50
9	合计	3,670,922,121.00	100.00

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发性零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	3,211,866,889.62	90.07
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	国防军工、管理和其他服务业	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
R	合计	3,211,866,889.62	90.07

1.1 主要财务指标
1.1.1 主要财务指标
1.1.2 主要财务指标

1.2 基金业绩
1.2.1 基金业绩
1.2.2 基金业绩

1.3 基金管理人承诺
1.3.1 基金管理人承诺
1.3.2 基金管理人承诺

1.4 基金管理人承诺
1.4.1 基金管理人承诺
1.4.2 基金管理人承诺

1.5 基金管理人承诺
1.5.1 基金管理人承诺
1.5.2 基金管理人承诺

1.6 基金管理人承诺
1.6.1 基金管理人承诺
1.6.2 基金管理人承诺

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	24,769,702	479,100,223.70	13.56
2	600877	海通证券	25,441,330	400,481,969.80	11.39
3	601888	华泰证券	10,261,765	200,380,181.76	5.73
4	000999	招商证券	9,109,742	197,681,401.40	5.59
5	000776	广发证券	9,276,790	180,315,200.65	5.10
6	000166	东方证券	13,077,177	149,287,101.43	4.22
7	601377	兴业证券	32,164,217	133,897,487.83	3.79
8	000773	东方钨业	10,413,020	129,259,842.28	3.66
9	000193	方正证券	12,914,043	123,974,319.30	3.51
10	000873	西部证券	3,483,680	114,974,628.28	3.25

1.1 主要财务指标
1.1.1 主要财务指标
1.1.2 主要财务指标

1.2 基金业绩
1.2.1 基金业绩
1.2.2 基金业绩