

中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金 2016年年度报告摘要

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况		基金资产组合情况	
序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	33,196,949.94	98.85
2	固定收益投资	-	-
3	其中:债券	33,196,949.94	98.85
4	其中:股票	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	基金投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他金融工具	-	-
9	买入返售金融资产	-	-
10	其他投资	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	368,077.38	1.10
12	其他资产	17,386.63	0.05
13	合计	33,584,407.95	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	行业名称	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	农林、牧、渔业	-	-
2	采矿业	-	-
3	制造业	-	-
4	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
5	建筑业	-	-
6	金融业	-	-
7	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
8	交通运输、仓储和邮政业	-	-
9	批发和零售业	-	-
10	住宿和餐饮业	-	-
11	房地产业	-	-
12	水利、环境和公共设施管理业	-	-
13	卫生和社会工作	-	-
14	文化、体育和娱乐业	-	-
15	综合	151,068.60	0.45
16	合计	33,196,949.94	99.97

8.3 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.4 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.5 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.6 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.7 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.8 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.9 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.10 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.11 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.12 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.13 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.14 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.15 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.16 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.17 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28

8.18 期末按行业分类的股票投资组合		基金资产组合情况	
序号	股票名称	数量(股)	公允价值
1	601318 中国平安	89,396	3,166,945.98
2	600166 民生银行	110,056	1,776,316.12
3	600016 民生银行	195,042	1,770,981.36
4	600036 招商银行	85,099	1,497,742.40
5	601328 交通银行	226,737	1,308,272.49
6	600000 浦发银行	71,323	1,156,145.83
7	000002 万科A	56,311	1,153,492.05
8	600837 中国海外发展	67,719	1,096,574.25
9	600030 中信证券	65,949	1,059,140.94
10	601169 北京银行	100,428	980,177.28