

招商财经大数据策略股票型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15

6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	46
§11 备查文件目录.....	47
11.1 备查文件目录.....	47

11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商财经大数据策略股票型证券投资基金
基金简称	招商财经大数据股票
基金主代码	003416
交易代码	003416
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 2 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,835,449.50 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过大数据量化选股模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>资产配置策略:本基金运用定量分析和定性分析手段，从宏观政策、经济环境、证券市场走势等方面对市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，据此合理制定和调整资产配置比例。</p> <p>股票投资策略:采用定量和定性结合的方式进行股票精选，充分利用东方财富网的投资者行为数据因子进行挖掘和优化，在控制风险的前提下增厚组合收益。</p> <p>债券投资策略:出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。</p> <p>资产支持证券投资策略:本基金将通过分析宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p> <p>权证投资策略:本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。</p> <p>中小企业私募债券投资策略:中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。</p> <p>股指期货投资策略:本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p>

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		招商基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	罗菲菲
	联系电话	0755-83196666	010-58560666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95568
传真		0755-83196475	010-58560798
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		中国深圳深南大道 7088 号 招商银行大厦	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		518040	100031
法定代表人		李浩	洪崎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	招商基金管理有限公司	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-7,364,239.00
本期利润	-8,648,308.11
加权平均基金份额本期利润	-0.1410
本期加权平均净值利润率	-15.55%
本期基金份额净值增长率	-15.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-8,121,369.78
期末可供分配基金份额利润	-0.1663
期末基金资产净值	40,714,079.72
期末基金份额净值	0.8337
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-16.63%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

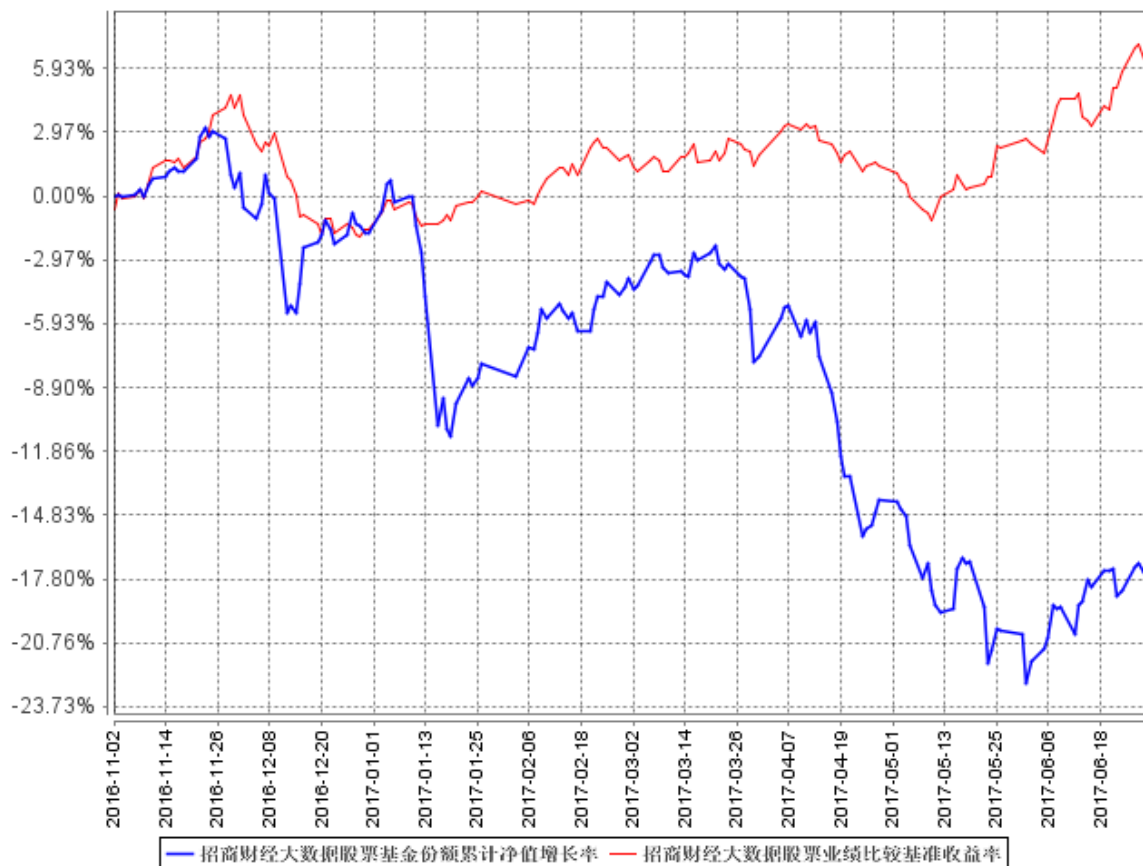
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.66%	1.11%	4.23%	0.54%	0.43%	0.57%
过去三个月	-9.88%	1.24%	4.91%	0.50%	-14.79%	0.74%
过去六个月	-15.19%	1.22%	8.54%	0.46%	-23.73%	0.76%
自基金合同生效起至今	-16.63%	1.18%	6.88%	0.50%	-23.51%	0.68%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商财经大数据股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2016 年 11 月 2 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会（2002）100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 2.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII（合格境内机构投资者）资格、专户理财（特定客户资产管理计划）资格。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 137 只基金，公募基金管理规模快速增长，公

募基金管理规模为 3711 亿元，行业排名第 6。

2017 年上半年获奖情况如下：

债券投资能力五星基金公司（海通证券）

晨星 2017 年度基金奖提名（晨星）

招商产业债•三年期开放式债券型持续优胜金牛基金《中国证券报》

金基金•股票投资回报基金管理公司奖《上海证券报》

招商双债增强•2016 年度金基金•一年期债券基金奖《上海证券报》

招商产业债•2016 年度金基金•三年期债券基金奖《上海证券报》

招商安瑞进取•三年持续回报积极债券型明星基金奖《证券时报》

招商产业债基金•三年持续回报普通债券型明星基金奖《证券时报》

招商丰融基金•2016 年度绝对收益明星基金奖《证券时报》

招商制造业转型基金•2016 年度平衡混合型明星基金奖《证券时报》

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王平	本基金 基金经 理	2016 年 11 月 2 日	-	11	男，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，历任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商深证 100 指数证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商央视财经 50 指数证券投资基金、招商中证银行指数分级证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理，现任量化投资部副总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、

					招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商中证 500 指数增强型证券投资基金及招商盛合灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人（以下简称“公司”）已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日

成交量的 5% 的情形。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金运用定量和定性结合的方式从宏观政策、经济环境、证券市场走势等方面对市场当期的系统性风险以及可预见的其他风险和预期收益率进行分析评估，据此制定和调整资产配置比例。本基金股票精选过程中，充分利用东方财富网的投资者行为数据因子，对股票组合进行挖掘和优化，以期在控制风险的前提下增厚组合收益。

本基金报告期内投资运作较为稳定，股票仓位总体维持在 90% 左右的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-15.19%，业绩比较基准收益率为 8.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年欧洲经济复苏势头强劲，宽松的货币政策刺激消费增长，利于企业扩大投资规模，经济超预期增长，但欧洲银行业危机与债务危机的风险点并未消除，仍存隐患。美国经济数据喜忧参半，就业数据显示接近充分就业，房地产市场持续回暖，ISM 制造业 PMI 显著回升，但其通胀数据持续疲弱，政治风险增强，随着“通俄门”和医改遇挫的发生，美国特朗普新政存有较大不确定性。

2017 年上半年经济保持增长，GDP 实际同比增长 6.9%，与一季度持平，6 月 PMI 新出口订单指数对新订单指数的贡献较前期持续上升；受去年同期基数较小、上半年财政发力影响，三大类投资均有所反弹；消费名义增速亦好于市场预期，从数据观察来看，通讯器材、文化办公、建筑装潢、日用品等增速反弹明显，持续性仍需观望。展望下半年，在监管力度加大，地方债务持续收紧的大背景下，投资增速、制造业扩张及消费支出能否持续有待观察，下半年经济能否持续增长存隐忧。

报告期内大小盘分化明显，创业板连续四个季度业绩增速不达预期，下半年业绩下滑风险不减，再加上监管压力，及经济去杠杆、金融防风险的政策态势，创业板等小盘股行情仍不容乐观，市场仍将偏好业绩增长确定性高的大盘蓝筹股，预计下半年大盘蓝筹走势仍将好于中小创。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工

作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场和交易所市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2017 年 4 月 13 日到 2017 年 6 月 30 日存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等

方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商财经大数据策略股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,849,440.68	853,334.65
结算备付金		168,681.95	10,914,630.94
存出保证金		56,579.56	31,239.51
交易性金融资产	6.4.7.2	37,036,897.77	70,137,701.73
其中：股票投资		37,036,897.77	70,137,701.73
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,000,000.00	-
应收证券清算款		623.42	-
应收利息	6.4.7.5	402.58	5,284.16
应收股利		-	-
应收申购款		8,342.62	76,167.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		41,120,968.58	82,018,358.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		70,540.02	434,846.77
应付管理人报酬		49,524.77	109,317.25
应付托管费		8,254.10	18,219.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	104,761.60	281,951.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	173,808.37	15,520.78
负债合计		406,888.86	859,855.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	48,835,449.50	82,564,272.71
未分配利润	6.4.7.10	-8,121,369.78	-1,405,769.85
所有者权益合计		40,714,079.72	81,158,502.86
负债和所有者权益总计		41,120,968.58	82,018,358.57

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8337 元，基金份额总额 48,835,449.50 份。

6.2 利润表

会计主体：招商财经大数据策略股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-7,391,906.38
1.利息收入		24,478.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	24,270.47
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		207.81
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,246,611.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,481,274.08
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	234,663.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填	6.4.7.18	-1,284,069.11

列)		
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	114,295.50
减:二、费用		1,256,401.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	417,908.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	69,651.43
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	587,715.87
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	181,125.54
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-8,648,308.11
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-8,648,308.11

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 招商财经大数据策略股票型证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	82,564,272.71	-1,405,769.85	81,158,502.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,648,308.11	-8,648,308.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-33,728,823.21	1,932,708.18	-31,796,115.03
其中: 1.基金申购款	8,567,244.02	-868,764.55	7,698,479.47
2. 基金赎回款	-42,296,067.23	2,801,472.73	-39,494,594.50
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基	48,835,449.50	-8,121,369.78	40,714,079.72

金净值)			
------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>金旭</u>	<u>欧志明</u>	<u>何剑萍</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商财经大数据策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1597 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 249,531,078.26 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(16)第 0883 号验资报告。《招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2016 年 11 月 2 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商财经大数据策略股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含中小企业私募债)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合为:投资于股票的比例为基金资产的 80%-95%,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为 80%×沪深 300 指数收益率+ 20%×中债综合指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至

2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金财务报告的编制期间自公历 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收

款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的不同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

— 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

— 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

基金投资收益为卖出或赎回基金成交日的成交总额扣除应结转的基金投资成本的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收益和基金分红收益于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票和基金所在地适用的预交所得税后的净额入账。

— 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计

提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 基金的收益分配采用现金方式或红利再投资方式, 基金份额持有人可自行选择收益分配方式; 基金份额持有人事先未做出选择的, 默认的分红方式为现金红利;

2) 每一基金份额享有同等分配权;

3) 基金可供分配的收益为正的情况下, 方可进行收益分配;

4) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值, 基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;

5) 在符合有关基金分红条件的前提下, 基金收益分配每年至多 12 次; 每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 20%;

6) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日;

7) 投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位, 小数点后第 3 位开始舍去, 舍去部分归基金资产;

8) 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度, 本基金整体为一个报告分部, 且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 2016 年 4 月 30 日 (含) 前以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

2) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

5) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	2,849,440.68
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,849,440.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	39,201,199.07	37,036,897.77	-2,164,301.30
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	39,201,199.07	37,036,897.77	-2,164,301.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	1,000,000.00	-
合计	1,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	727.02
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	68.31
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-415.61
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	22.86
合计	402.58

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	104,761.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	104,761.60

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	247.47
预提费用	173,560.90
合计	173,808.37

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	82,564,272.71	82,564,272.71
本期申购	8,567,244.02	8,567,244.02
本期赎回(以“-”号填列)	-42,296,067.23	-42,296,067.23
本期末	48,835,449.50	48,835,449.50

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	470,651.41	-1,876,421.26	-1,405,769.85
本期利润	-7,364,239.00	-1,284,069.11	-8,648,308.11
本期基金份额交易产生的变动数	967,258.23	965,449.95	1,932,708.18
其中：基金申购款	-252,378.49	-616,386.06	-868,764.55
基金赎回款	1,219,636.72	1,581,836.01	2,801,472.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,926,329.36	-2,195,040.42	-8,121,369.78

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	18,850.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,914.89
其他	505.00
合计	24,270.47

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	201,877,705.00
减：卖出股票成本总额	208,358,979.08
买卖股票差价收入	-6,481,274.08

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	234,663.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	234,663.03

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,284,069.11
——股票投资	-1,284,069.11
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,284,069.11

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	112,105.80
转换费收入	2,189.70
合计	114,295.50

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回

基金份额时收取，赎回费总额按一定比例归入基金资产；

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额按一定比例归入转出基金的基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	587,715.87
银行间市场交易费用	-
合计	587,715.87

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
银行费用	1,564.64
其他	6,000.00
合计	181,125.54

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
民生银行	基金托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	417,908.89
其中：支付销售机构的客户维护费	135,935.47

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	69,651.43

注：支付基金托管人民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
民生银行	2,849,440.68	18,850.58

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300092	科新机电	2017年4月14日	重大事项	12.70	-	-	42,023	570,471.30	533,692.10	-
300022	吉峰农机	2017年5	重大事项	6.72	-	-	42,700	396,877.09	286,944.00	-

		月 23 日									
600193	创兴资源	2017 年 6 月 1 日	重大事项	6.77	-	-	41,600	288,554.00	281,632.00	-	
300163	先锋新材	2017 年 4 月 26 日	重大事项	7.60	-	-	28,000	238,400.00	212,800.00	-	
601313	江南嘉捷	2017 年 6 月 13 日	重大事项	8.79	-	-	20,200	236,616.42	177,558.00	-	
000656	金科股份	2017 年 5 月 5 日	重大事项	6.54	2017 年 7 月 5 日	5.92	22,000	130,527.00	143,880.00	-	
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重大事项	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	24,500	87,036.00	84,035.00	-	
600057	象屿股份	2017 年 6 月 27 日	重大事项	10.17	2017 年 7 月 4 日	10.17	7,400	74,976.00	75,258.00	-	
000932	*ST 华菱	2017 年 6 月 15 日	重大事项	3.89	2017 年 7 月 10 日	4.08	4,200	20,160.00	16,338.00	-	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层

次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人民生银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产款外，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,849,440.68	-	-	-	-	-	2,849,440.68
结算备付金	168,681.95	-	-	-	-	-	168,681.95
存出保证金	56,579.56	-	-	-	-	-	56,579.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	37,036,897.77	37,036,897.77
买入返售金融资产	1,000,000.00	-	-	-	-	-	1,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	623.42	623.42
应收利息	-	-	-	-	-	402.58	402.58
应收申购款	-	-	-	-	-	8,342.62	8,342.62
资产总计	4,074,702.19	-	-	-	-	37,046,266.39	41,120,968.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	70,540.02	70,540.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,524.77	49,524.77
应付托管费	-	-	-	-	-	8,254.10	8,254.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	104,761.60	104,761.60
其他负债	-	-	-	-	-	173,808.37	173,808.37
负债总计	-	-	-	-	-	406,888.86	406,888.86
利率敏感度缺口	4,074,702.19	-	-	-	-	-36,639,377.53	40,714,079.72
上年度末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	853,334.65	-	-	-	-	-	853,334.65
结算备付金	10,914,630.94	-	-	-	-	-	10,914,630.94
存出保证金	31,239.51	-	-	-	-	-	31,239.51
交易性金融资产	-	-	-	-	-	70,137,701.73	70,137,701.73

应收利息	-	-	-	-	5,284.16	5,284.16
应收申购款	-	-	-	-	76,167.58	76,167.58
资产总计	11,799,205.10	-	-	-	70,219,153.47	82,018,358.57
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	434,846.77	434,846.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	109,317.25	109,317.25
应付托管费	-	-	-	-	18,219.52	18,219.52
应付交易费用	-	-	-	-	281,951.39	281,951.39
其他负债	-	-	-	-	15,520.78	15,520.78
负债总计	-	-	-	-	859,855.71	859,855.71
利率敏感度缺口	11,799,205.10	-	-	-	-69,359,297.76	81,158,502.86

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	37,036,897.77	90.97	70,137,701.73	86.42
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	37,036,897.77	90.97	70,137,701.73	86.42

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	1,851,844.89	3,506,885.09
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-1,851,844.89	-3,506,885.09

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,036,897.77	90.07
	其中：股票	37,036,897.77	90.07
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,000,000.00	2.43
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,018,122.63	7.34
7	其他各项资产	65,948.18	0.16
8	合计	41,120,968.58	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	777,362.00	1.91
B	采矿业	1,567,631.00	3.85

C	制造业	24,915,838.22	61.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,610,222.00	3.95
E	建筑业	709,184.00	1.74
F	批发和零售业	2,512,847.40	6.17
G	交通运输、仓储和邮政业	666,341.15	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	466,599.00	1.15
J	金融业	2,129,436.80	5.23
K	房地产业	1,193,094.20	2.93
L	租赁和商务服务业	92,225.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	396,117.00	0.97
S	综合	-	-
	合计	37,036,897.77	90.97

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300092	科新机电	42,023	533,692.10	1.31
2	601166	兴业银行	27,000	455,220.00	1.12
3	000637	茂化实华	66,300	440,232.00	1.08
4	603518	维格娜丝	17,600	430,496.00	1.06
5	601818	光大银行	103,600	419,580.00	1.03
6	600015	华夏银行	44,640	411,580.80	1.01
7	600356	恒丰纸业	41,300	410,522.00	1.01
8	300305	裕兴股份	43,200	387,072.00	0.95
9	300286	安科瑞	18,700	385,781.00	0.95
10	600213	亚星客车	33,952	367,021.12	0.90
11	300452	山河药辅	13,300	365,750.00	0.90

12	300387	富邦股份	18,457	365,448.60	0.90
13	002144	宏达高科	20,400	346,800.00	0.85
14	600203	福日电子	37,700	316,303.00	0.78
15	601318	中国平安	5,800	287,738.00	0.71
16	300022	吉峰农机	42,700	286,944.00	0.70
17	600889	南京化纤	30,200	286,598.00	0.70
18	600193	创兴资源	41,600	281,632.00	0.69
19	601225	陕西煤业	36,700	259,469.00	0.64
20	600051	宁波联合	26,000	248,560.00	0.61
21	300106	西部牧业	23,200	248,472.00	0.61
21	300132	青松股份	30,600	248,472.00	0.61
22	600768	宁波富邦	15,400	247,016.00	0.61
23	600308	华泰股份	42,500	241,400.00	0.59
24	002615	哈尔斯	20,925	236,452.50	0.58
25	603002	宏昌电子	44,300	234,790.00	0.58
26	000419	通程控股	32,500	230,100.00	0.57
27	002708	光洋股份	24,800	227,912.00	0.56
28	300394	天孚通信	8,700	222,633.00	0.55
29	600644	乐山电力	29,300	222,387.00	0.55
30	000830	鲁西化工	32,200	222,180.00	0.55
31	002687	乔治白	28,700	220,990.00	0.54
32	300483	沃施股份	6,600	220,770.00	0.54
33	300489	中飞股份	9,300	220,038.00	0.54
34	300403	地尔汉宇	12,100	219,978.00	0.54
35	600461	洪城水业	30,400	219,184.00	0.54
36	000713	丰乐种业	26,700	218,673.00	0.54
37	600325	华发股份	26,140	218,269.00	0.54
38	300375	鹏翎股份	11,000	217,470.00	0.53
39	600966	博汇纸业	41,900	217,461.00	0.53
40	002790	瑞尔特	6,700	217,147.00	0.53
41	002172	澳洋科技	26,800	215,472.00	0.53
42	300204	舒泰神	13,800	215,142.00	0.53
43	600493	凤竹纺织	19,700	215,124.00	0.53
44	601666	平煤股份	40,500	213,435.00	0.52
45	300254	仟源医药	15,000	213,150.00	0.52
46	600081	东风科技	17,100	212,895.00	0.52
47	300163	先锋新材	28,000	212,800.00	0.52
48	600746	江苏索普	19,700	212,366.00	0.52
49	300220	金运激光	11,400	212,154.00	0.52

50	300390	天华超净	23,022	211,111.74	0.52
51	600982	宁波热电	43,600	211,024.00	0.52
52	300211	亿通科技	23,303	209,727.00	0.52
53	600816	安信信托	15,400	209,286.00	0.51
54	603101	汇嘉时代	12,600	209,160.00	0.51
55	002753	永东股份	11,250	208,912.50	0.51
56	600883	博闻科技	17,900	208,893.00	0.51
57	600796	钱江生化	24,860	208,824.00	0.51
58	600567	山鹰纸业	58,300	208,714.00	0.51
59	600513	联环药业	20,400	208,284.00	0.51
60	601233	桐昆股份	15,000	207,900.00	0.51
61	300218	安利股份	17,990	207,244.80	0.51
62	002763	汇洁股份	7,200	207,000.00	0.51
63	300264	佳创视讯	23,400	206,856.00	0.51
64	603599	广信股份	13,600	205,768.00	0.51
65	600448	华纺股份	34,700	204,730.00	0.50
66	603223	恒通股份	8,367	204,573.15	0.50
67	300283	温州宏丰	28,300	204,326.00	0.50
68	002084	海鸥卫浴	22,900	203,581.00	0.50
69	600605	汇通能源	12,100	203,522.00	0.50
70	600695	绿庭投资	30,900	203,322.00	0.50
71	300169	天晟新材	25,767	202,270.95	0.50
72	002165	红宝丽	32,400	200,556.00	0.49
73	601900	南方传媒	16,100	200,284.00	0.49
74	300443	金雷风电	9,300	199,206.00	0.49
75	300354	东华测试	12,800	198,528.00	0.49
76	000421	南京公用	27,000	197,100.00	0.48
77	601368	绿城水务	20,000	196,800.00	0.48
78	600229	城市传媒	20,900	195,833.00	0.48
79	300330	华虹计通	15,100	195,243.00	0.48
80	300164	通源石油	28,500	195,225.00	0.48
81	300389	艾比森	13,400	194,836.00	0.48
82	600302	标准股份	23,446	194,601.80	0.48
83	600530	交大昂立	34,300	193,795.00	0.48
84	300126	锐奇股份	22,000	192,060.00	0.47
85	300341	麦迪电气	22,177	191,831.05	0.47
86	600333	长春燃气	27,700	190,576.00	0.47
87	002014	永新股份	15,100	190,411.00	0.47
88	300360	炬华科技	12,600	189,630.00	0.47

89	300046	台基股份	10,100	188,870.00	0.46
90	300139	晓程科技	17,900	187,771.00	0.46
91	002150	通润装备	15,900	186,825.00	0.46
92	300321	同大股份	8,231	185,691.36	0.46
93	002452	长高集团	27,000	185,490.00	0.46
94	600371	万向德农	15,400	184,492.00	0.45
95	002357	富临运业	17,600	184,448.00	0.45
96	300179	四方达	28,200	184,428.00	0.45
97	300243	瑞丰高材	16,700	184,201.00	0.45
98	603701	德宏股份	5,875	181,302.50	0.45
99	000890	法尔胜	22,200	180,708.00	0.44
100	603520	司太立	5,700	178,923.00	0.44
101	601313	江南嘉捷	20,200	177,558.00	0.44
102	000898	鞍钢股份	31,000	175,460.00	0.43
103	002073	软控股份	20,600	174,688.00	0.43
104	300214	日科化学	26,000	174,460.00	0.43
105	600409	三友化工	17,100	172,197.00	0.42
106	000951	中国重汽	11,200	171,248.00	0.42
107	603309	维力医疗	9,600	170,784.00	0.42
108	600782	新钢股份	46,100	168,265.00	0.41
109	000338	潍柴动力	12,700	167,640.00	0.41
110	601898	中煤能源	28,300	166,404.00	0.41
111	601678	滨化股份	22,300	154,985.00	0.38
112	002092	中泰化学	12,100	153,670.00	0.38
113	600742	一汽富维	7,900	150,969.00	0.37
114	601636	旗滨集团	33,142	149,470.42	0.37
115	600801	华新水泥	15,500	147,715.00	0.36
116	000900	现代投资	15,700	144,440.00	0.35
117	600810	神马股份	18,200	144,326.00	0.35
118	000656	金科股份	22,000	143,880.00	0.35
119	000686	东北证券	14,200	142,710.00	0.35
120	000683	远兴能源	52,400	141,480.00	0.35
121	000725	京东方A	33,700	140,192.00	0.34
122	002582	好想你	11,400	137,028.00	0.34
123	000550	江铃汽车	6,600	136,620.00	0.34
124	600708	光明地产	20,280	134,659.20	0.33
125	002078	太阳纸业	18,200	133,770.00	0.33
126	600475	华光股份	6,700	133,531.00	0.33
127	600039	四川路桥	31,600	131,456.00	0.32

128	000059	华锦股份	12,400	124,124.00	0.30
129	002221	东华能源	11,100	121,101.00	0.30
130	600282	南钢股份	30,800	114,268.00	0.28
131	601699	潞安环能	14,400	112,608.00	0.28
132	002109	兴化股份	13,600	109,888.00	0.27
133	600521	华海药业	5,000	105,200.00	0.26
134	000028	国药一致	1,300	105,170.00	0.26
135	002680	长生生物	6,800	103,972.00	0.26
136	002462	嘉事堂	2,600	102,154.00	0.25
137	600572	康恩贝	14,700	101,724.00	0.25
138	300335	迪森股份	5,300	101,601.00	0.25
139	000423	东阿阿胶	1,400	100,646.00	0.25
140	600755	厦门国贸	11,000	100,320.00	0.25
141	000963	华东医药	2,000	99,400.00	0.24
142	600420	现代制药	6,300	98,847.00	0.24
143	601015	陕西黑猫	13,000	98,800.00	0.24
144	002007	华兰生物	2,700	98,550.00	0.24
145	600079	人福医药	5,000	98,100.00	0.24
146	600808	马钢股份	26,800	94,872.00	0.23
147	601668	中国建筑	9,600	92,928.00	0.23
148	000701	厦门信达	7,200	90,000.00	0.22
149	000540	中天金融	12,800	88,960.00	0.22
150	600188	兖州煤业	7,200	88,128.00	0.22
151	000488	晨鸣纸业	6,700	86,430.00	0.21
152	000938	紫光股份	1,400	85,568.00	0.21
153	600348	阳泉煤业	12,600	85,428.00	0.21
154	000926	福星股份	7,000	85,400.00	0.21
155	600153	建发股份	6,600	85,338.00	0.21
156	000761	本钢板材	16,300	85,249.00	0.21
157	000100	TCL 集团	24,500	84,035.00	0.21
158	600675	中华企业	12,300	83,763.00	0.21
159	300116	坚瑞沃能	7,600	81,700.00	0.20
160	300256	星星科技	7,800	81,120.00	0.20
161	600546	山煤国际	16,900	80,951.00	0.20
162	600569	安阳钢铁	28,400	80,372.00	0.20
163	600115	东方航空	11,700	79,560.00	0.20
164	000528	柳 工	9,200	79,488.00	0.20
165	002156	通富微电	7,800	79,404.00	0.20
166	002061	江山化工	8,300	78,684.00	0.19

167	601899	紫金矿业	22,900	78,547.00	0.19
168	002132	恒星科技	16,800	78,120.00	0.19
169	600507	方大特钢	9,100	77,623.00	0.19
170	600500	中化国际	8,100	77,436.00	0.19
171	601600	中国铝业	17,100	77,292.00	0.19
172	000425	徐工机械	20,500	76,875.00	0.19
173	000990	诚志股份	4,800	76,704.00	0.19
174	600141	兴发集团	6,200	76,694.00	0.19
175	600596	新安股份	9,000	76,050.00	0.19
176	601958	金钼股份	10,600	76,002.00	0.19
177	002106	莱宝高科	7,500	75,975.00	0.19
178	600466	蓝光发展	8,800	75,944.00	0.19
179	600168	武汉控股	8,400	75,684.00	0.19
180	000822	山东海化	9,300	75,516.00	0.19
181	600057	象屿股份	7,400	75,258.00	0.18
182	600758	红阳能源	8,400	75,096.00	0.18
183	002042	华孚色纺	7,000	74,830.00	0.18
184	600971	恒源煤电	9,100	73,983.00	0.18
185	002683	宏大爆破	8,200	73,964.00	0.18
186	600502	安徽水利	9,600	73,824.00	0.18
187	000597	东北制药	6,600	73,788.00	0.18
188	600048	保利地产	7,400	73,778.00	0.18
189	600021	上海电力	6,100	73,749.00	0.18
190	601058	赛轮金宇	21,500	73,530.00	0.18
191	300083	劲胜智能	7,900	72,996.00	0.18
192	000581	威孚高科	2,800	72,520.00	0.18
193	002601	龙蟠佰利	4,400	72,072.00	0.18
194	600068	葛洲坝	6,400	71,936.00	0.18
195	002145	中核钛白	11,800	71,744.00	0.18
196	002101	广东鸿图	3,000	71,670.00	0.18
197	600180	瑞茂通	5,100	71,604.00	0.18
198	000545	金浦钛业	12,200	71,370.00	0.18
199	002589	瑞康医药	4,600	70,840.00	0.17
200	600073	上海梅林	7,400	70,670.00	0.17
201	002037	久联发展	5,200	70,304.00	0.17
202	603369	今世缘	5,300	69,960.00	0.17
203	600166	福田汽车	24,600	69,864.00	0.17
204	600067	冠城大通	10,100	69,387.00	0.17
205	600123	兰花科创	9,100	69,342.00	0.17

206	600628	新世界	6,000	69,300.00	0.17
207	002133	广宇集团	12,500	69,250.00	0.17
208	600529	山东药玻	2,800	68,796.00	0.17
209	000789	万年青	9,700	68,773.00	0.17
210	600328	兰太实业	5,900	68,676.00	0.17
211	600345	长江通信	3,300	68,013.00	0.17
212	600597	光明乳业	5,300	67,575.00	0.17
213	600720	祁连山	8,600	67,338.00	0.17
214	002440	闰土股份	4,400	67,144.00	0.16
215	601155	新城控股	3,600	66,744.00	0.16
216	002564	天沃科技	7,300	66,649.00	0.16
217	000036	华联控股	7,300	66,430.00	0.16
218	000735	罗牛山	10,600	66,250.00	0.16
219	000936	华西股份	9,400	65,988.00	0.16
220	600668	尖峰集团	3,800	65,284.00	0.16
221	002637	赞宇科技	6,100	65,270.00	0.16
222	300194	福安药业	9,300	64,635.00	0.16
223	002354	天神娱乐	3,000	64,500.00	0.16
224	000635	英力特	3,800	64,410.00	0.16
225	300138	晨光生物	4,900	64,288.00	0.16
226	002759	天际股份	2,400	61,368.00	0.15
227	000858	五粮液	1,100	61,226.00	0.15
228	300189	神农基因	18,300	59,475.00	0.15
229	600326	西藏天路	5,200	57,408.00	0.14
230	002454	松芝股份	4,400	55,440.00	0.14
231	600350	山东高速	8,600	53,320.00	0.13
232	600295	鄂尔多斯	5,100	52,020.00	0.13
233	000625	长安汽车	3,300	47,586.00	0.12
234	600674	川投能源	4,400	43,208.00	0.11
235	600236	桂冠电力	7,400	42,180.00	0.10
236	000957	中通客车	3,400	39,780.00	0.10
237	000543	皖能电力	6,300	36,729.00	0.09
238	600219	南山铝业	10,400	35,256.00	0.09
239	600390	五矿资本	2,800	33,908.00	0.08
240	000751	锌业股份	6,500	31,915.00	0.08
241	600581	八一钢铁	2,300	23,161.00	0.06
242	600089	特变电工	1,966	20,308.78	0.05
243	600019	宝钢股份	3,000	20,130.00	0.05
244	002202	金风科技	1,300	20,111.00	0.05

245	000501	鄂武商 A	1,040	19,198.40	0.05
246	600312	平高电气	1,300	17,862.00	0.04
247	000882	华联股份	4,700	16,967.00	0.04
248	000042	中洲控股	1,000	16,630.00	0.04
249	600803	新奥股份	1,200	16,488.00	0.04
250	000587	金洲慈航	1,100	16,390.00	0.04
251	000932	*ST 华菱	4,200	16,338.00	0.04
252	600585	海螺水泥	400	9,092.00	0.02
253	000030	富奥股份	600	5,364.00	0.01
254	000933	神火股份	600	4,374.00	0.01
255	000055	方大集团	550	4,004.00	0.01
256	600382	广东明珠	200	2,882.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300464	星徽精密	2,326,854.50	2.87
2	300218	安利股份	2,213,414.69	2.73
3	300442	普丽盛	2,150,319.49	2.65
4	300286	安科瑞	1,989,623.00	2.45
5	603022	新通联	1,844,138.00	2.27
6	600671	天目药业	1,770,007.16	2.18
7	300421	力星股份	1,748,607.00	2.15
8	300019	硅宝科技	1,724,984.00	2.13
9	300169	天晟新材	1,692,945.74	2.09
10	603828	柯利达	1,588,336.95	1.96
11	603726	朗迪集团	1,514,331.00	1.87
12	000929	兰州黄河	1,497,229.00	1.84
13	002757	南兴装备	1,495,289.00	1.84
14	300445	康斯特	1,494,362.00	1.84
15	603822	嘉澳环保	1,479,569.00	1.82
16	603029	天鹅股份	1,476,752.00	1.82
17	300211	亿通科技	1,475,732.86	1.82
18	300488	恒锋工具	1,467,393.00	1.81

19	603696	安记食品	1,463,885.86	1.80
20	300509	新美星	1,437,441.00	1.77

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000695	滨海能源	2,393,978.79	2.95
2	600444	国机通用	2,312,199.58	2.85
3	002755	东方新星	2,309,183.44	2.85
4	600506	香梨股份	2,290,312.16	2.82
5	600302	标准股份	2,210,082.04	2.72
6	300464	星徽精密	2,157,968.64	2.66
7	600796	钱江生化	2,082,162.03	2.57
8	600746	江苏索普	2,054,282.60	2.53
9	603022	新通联	1,988,928.88	2.45
10	300405	科隆股份	1,924,091.72	2.37
11	300442	普丽盛	1,919,195.36	2.36
12	600671	天目药业	1,900,468.00	2.34
13	300218	安利股份	1,776,950.06	2.19
14	600152	维科精华	1,712,410.00	2.11
15	300421	力星股份	1,692,595.65	2.09
16	002760	凤形股份	1,650,654.53	2.03
17	600243	青海华鼎	1,636,080.00	2.02
18	603696	安记食品	1,621,394.48	2.00
19	002696	百洋股份	1,611,991.00	1.99
20	300019	硅宝科技	1,602,661.02	1.97

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	176,542,244.23
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	201,877,705.00
--------------	----------------

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	56,579.56
2	应收证券清算款	623.42
3	应收股利	-
4	应收利息	402.58
5	应收申购款	8,342.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,948.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300092	科新机电	533,692.10	1.31	重大事项

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,116	23,079.13	796,547.69	1.63%	48,038,901.81	98.37%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	11,970.85	0.0245%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年11月2日）基金份额总额	249,531,078.26
本报告期期初基金份额总额	82,564,272.71
本报告期基金总申购份额	8,567,244.02
减：本报告期基金总赎回份额	42,296,067.23
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	48,835,449.50

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未作改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人及其高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	378,262,634.12	100.00%	352,275.51	100.00%	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量以及销售服务质量打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	-	-	2,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报、证券时报、证券日报	2017年1月7日
2	招商基金旗下部分基金增加蚂蚁基金为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、证券日报	2017年1月11日
3	招商基金旗下部分基金增加创金启富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、证券日报	2017年3月17日
4	招商基金旗下部分基金增加联储证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、证券日报	2017年3月22日
5	招商财经大数据策略股票型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、证券日报	2017年4月21日
6	招商基金旗下部分基金增加上海挖财为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、证券日报	2017年4月28日
7	招商基金旗下部分基金增加华夏财富等机构为代销机构及开通定投和转换	中国证券报、证券时报、证券日报	2017年5月3日

	业务并参与其费率优惠活动的公告		
8	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、证券时报、证券日报	2017年5月24日
9	招商财经大数据策略股票型证券投资基金更新的招募说明书（二零一七年第一号）	中国证券报、证券时报、证券日报	2017年6月14日
10	招商财经大数据策略股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零一七年第一号）	中国证券报、证券时报、证券日报	2017年6月14日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商财经大数据策略股票型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商财经大数据策略股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商财经大数据策略股票型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

11.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站 <http://www.cmfchina.com> 上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2017年8月29日