

招商财经大数据策略股票型证券投资基金 清算报告

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

清算报告出具日：2022年12月9日

清算报告公告日：2022年12月17日

一、 重要提示

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”）经中国证券监督管理委员会 2016 年 7 月 13 日《关于准予招商财经大数据策略股票型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】1597 号）注册公开募集，自 2016 年 11 月 2 日起基金合同生效，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》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：（二）基金份额持有人大会决定终止”。根据《招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的“二、《基金合同》的终止事由”中约定，“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

为召集基金份额持有人大会审议《关于终止招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金管理人已于 2022 年 10 月 18 日刊登了《招商基金管理有限公司关于以通讯方式召开招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于 2022 年 10 月 19 日、2022 年 10 月 20 日陆续刊登了提示性公告。本次基金份额持有人大会于 2022 年 12 月 1 日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效，基金管理人于 2022 年 12 月 2 日刊登了《关于招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市中伦律师事务所于 2022 年 12 月 5 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，北京市中伦律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、 基金概况

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
最后运作日（2022-12-2） 基金份额总额	5,834,695.61份
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>（一）资产配置策略</p> <p>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。通过对股票、债券等各类资产进行配置，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合资产的稳定增值。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>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>就定量方面，在剔除全A股市场ST股票及流动性最差的10%的股票部分后，将依据量化投资部门研发的量化模型对上市公司进行下一步的筛选。该量化模型通过对东方财富网大数据（包括股票关注度、点击量等投资者行为数据）进行分析和研究，深度分析投资者的行为规律，并提炼出能对股价短期收益率产生较强预测性的行为因子。再结合上市公司的成长性因子、盈利性因子、估值类因子及对应股票标的的市值因子、流动性因子、技术性因子等做进一步的筛选。为避免不同因子对股价影响的相关性过强，在基金日常管理运作中，主要采取聚类分析和因子打分的方式选取符合最终筛选条件的股票。由于因子的持续期有限，日常管理会对各类因子保持动态监控，及时剔除效果不明显的因子。</p> <p>就定性方面，在满足定量筛选条件的股票样本中，基金经理将结合资产的总量和冲击性成本，选择性的剔除在财务质量方面存在严重缺陷或近期存在极大负面信息的备选样本，最大程度降低组合潜在的不利因素。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>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。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根</p>

	<p>据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>（四）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、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。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>（五）权证投资策略</p> <p>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>（六）中小企业私募债券投资策略</p> <p>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。针对市场系统性信用风险，本基金主要通过调整中小企业私募债类属资产的配置比例，谋求避险增收。针对非系统性信用风险，本基金通过分析发债主体的信用水平及个债增信措施，量化比较判断估值，精选个债，谋求避险增收。本基金主要采取买入持有到期策略；当预期发债企业的基本面情况出现恶化时，采取“尽早出售”策略，控制投资风险。另外，部分中小企业私募债内嵌转股选择权，本基金将通过深入的基本面分析及定性定量研究，自下而上地精选个债，在控制风险的前提下，谋求内嵌转股权潜在的增强收益。</p> <p>（七）股指期货投资策略</p> <p>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。随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</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。	
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	
下属分级基金的基金简称	招商财经大数据股票 A	招商财经大数据股票 C
下属分级基金的交易代码	003416	007952
最后运作日（2022-12-2） 下属分级基金的份额总额	5,260,613.12 份	574,082.49 份

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会 2016 年 7 月 13 日证监许可【2016】1597 号文注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定自 2016 年 10 月 10 日至 2016 年 10 月 28 日止向社会公开募集。本基金基金合同于 2016 年 11 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额（含利息结转的份额）总数为 249,531,078.26 份。自 2016 年 11 月 2 日至 2022 年 12 月 2 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

根据《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》、《招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金合同》等有关规定，经本基金份额持有人大会 2022 年 12 月 1 日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于 2022 年 12 月 2 日刊登了《关于招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金从 2022 年 12 月 5 日起进入清算期。

四、 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

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：2022 年 12 月 2 日

单位：人民币元

	最后运作日 2022 年 12 月 2 日
资产：	
银行存款	1,295,517.00
结算备付金	1,439.52
存出保证金	4,396.82
交易性金融资产	5,514,712.47
应收销售款	26,922.14
资产总计	6,842,987.95
负债：	
应付赎回款	58,381.76
应付赎回费	2.39
应付管理人报酬	375.25
应付托管费	56.28
应付销售服务费	21.25

应付交易费用	1,378.79
负债合计	60,215.72
所有者权益：	
实收基金	5,834,695.61
未分配利润	948,076.62
所有者权益合计	6,782,772.23
负债和所有者权益总计	6,842,987.95

注：1、基金最后运作日 2022 年 12 月 2 日，招商财经大数据股票 A 单位净值为 1.1642 元，份额为 5,260,613.12 份，资产净值为 6,124,202.75 元，招商财经大数据股票 C 单位净值为 1.1472，份额为 574,082.49 份，资产净值为 658,569.48 元；

2、本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。

五、清算情况

自 2022 年 12 月 5 日至 2022 年 12 月 9 日止为清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《招商财经大数据策略股票型证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人承担并支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款 1,295,517.00 元，其中 1,294,132.47 元为存储于基金托管人中国民生银行的活期银行存款，1,384.53 元为应计活期银行存款利息；

(2) 本基金最后运作日最低结算备付金 1,439.52 元，其中 1,419.96 元为由中国证券登记结算公司收取并保管的最低结算备付金，19.56 元为应计最低结算备付金利息；

(3) 本基金最后运作日存出保证金 4,396.82 元，其中 4,382.72 元由中国证券登记结算公司收取并保管的存出保证金，14.10 元为应计存出保证金利息；

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产 5,514,712.47 元,均为股票资产,本基金已于 2022 年 12 月 5 日完成相关资产的变现;

(5) 本基金最后运作日应收销售款 26,922.14 元,为 12 月 2 日确认的申购款,已分别于 12 月 5 日和 12 月 6 日结算入账。

为保护基金份额持有人利益,加快清盘速度,基金管理人将以自有资金先行垫付尚未返还的存出保证金、应计活期银行存款利息、应计最低备付金利息、应计存出保证金利息。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为 58,381.76 元,该款项已分别于 2022 年 12 月 5 日和 12 月 6 日支付;

(2) 本基金最后运作日应付赎回费为 2.39 元,该款项已分别于 2022 年 12 月 5 日和 12 月 6 日支付;

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 375.25 元,该款项已于 2022 年 12 月 6 日支付;

(4) 本基金最后运作日应付托管费为 56.28 元,该款项已于 2022 年 12 月 6 日支付;

(5) 本基金最后运作日应付销售服务费为 21.25 元,该款项已于 2022 年 12 月 6 日支付;

(6) 本基金最后运作日应付交易费用为 1,378.79 元,该款项已于 2022 年 12 月 6 日支付。

3、清算期间的剩余资产分配情况

单位:人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 12 月 2 日基金净资产	6,782,772.23
加:清算期间(2022-12-5 至 2022-12-9)利息收入	222.78
利息收入-银行存款利息收入(注 1)	220.96
利息收入-结算备付金利息收入(注 1)	0.42
利息收入-存出保证金利息收入(注 1)	1.40
加:其他业务收入-公允价值变动损益(注 2)	80,299.19
加:其他收入-赎回费归资产(注 3)	2,056.56
减:清算期间(2022-12-5 至 2022-12-9)费用	47,981.02
投资收益(注 4)	36,737.39
交易费用(注 5)	11,173.63
其他费用-汇划费(注 6)	70.00
减:基金净赎回金额(于 2022 年 12 月 5 日确认的投资者申购赎回申请)	1,290,583.30
二、2022 年 12 月 9 日基金净资产	5,526,786.44

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2022 年 12 月 3 日至 2022 年 12 月 9 日清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息，A/C 类份额之间的收入分配按照各级别净值占比进行分配；

2、公允价值变动损益为 12 月 5 日交易性金融资产在变现时所结转的累计公允价值变动损益，A/C 类份额之间的收入分配按照各级别净值占比进行分配；

3、赎回费归资产为 12 月 5 日确认的基金赎回款中归属于基金资产的收入，根据 A/C 类份额实际发生额归入各类份额资产；

4、投资收益为 12 月 5 日交易性金融资产变现时产生的投资收益以及 12 月 6 日因为卖券产生的股息红利税，A/C 类份额之间的费用分配按照各级别净值占比进行分摊；

5、交易费用为 12 月 5 日交易性金融资产变现时产生的费用，A/C 类份额之间的费用分配按照各级别净值占比进行分摊；

6、汇划费为清算期间银行划拨各类款项所产生的费用，A/C 类份额之间的费用分配按照各级别净值占比进行分摊。

资产处置及负债清偿后，于 2022 年 12 月 9 日本基金剩余财产为人民币 5,526,786.44 元，根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，按各级别基金份额持有人持有该级别份额的比例进行分配。

2022 年 12 月 10 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

4、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、 备查文件

1、备查文件目录

- (1)《招商财经大数据策略股票型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《关于招商财经大数据策略股票型证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。

招商财经大数据策略股票型证券投资基金财产清算小组

2022年12月17日