招商财经大数据策略股票型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年3月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本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2019年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计,德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2018年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	27,699,995.91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	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。 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。 债券投资策略:由于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量,本基金运时对债券进行投资。 资产支持证券投资策略:本基金将通过对宏观经济、提前借出率、资产池特征以及资产池资产所在行业景气度化等因素的研究,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。 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——标的资产的价格以及市场隐含波动率的变化,灵活构建股票策略,波动率策略以及套利策略。 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。 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。
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	罗雪雪
	联系电话	0755-83196666	010-58560666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	tgbh@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95568
传真		0755-83196475	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年11月2日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	-2,887,960.19	-8,533,838.74	1,949,393.27
本期利润	-6,229,466.17	-7,010,754.70	1,069,161.08
加权平均基金份额本期利润	-0.2163	-0.1371	0.0075
本期基金份额净值增长率	-26.53%	-12.17%	-1.70%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3647	-0.1486	-0.0170
期末基金资产净值	17,570,676.04	30,137,725.26	81,158,502.86
期末基金份额净值	0.6343	0.8634	0.9830

注:1、基金业绩指标不包括持有人认(申)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;

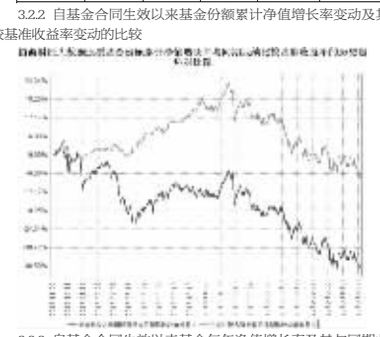
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

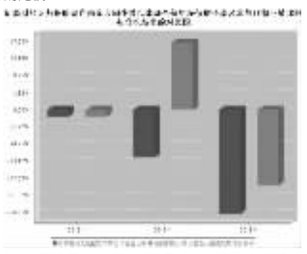
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-12.63%	1.71%	-9.50%	1.31%	-3.13%	0.40%
过去六个月	-17.23%	1.54%	-10.64%	1.20%	-6.59%	0.34%
过去一年	-26.53%	1.38%	-19.26%	1.07%	-7.27%	0.31%
自基金合同生效起至今	-36.57%	1.22%	-6.80%	0.82%	-29.77%	0.40%

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金于2016年11月2日成立,截至2016年12月31日基金成立未满1年,故成立当年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2016年11月2日成立,自基金合同生效日以来未进行利润分配。

§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,公司注册资本金为人民币13.1亿元,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。

2018年获奖情况如下:

债券投资能力五星基金公司·海通证券

英华奖公募基金20年特别评选·公募基金20年最佳回报债券型基金 (二级债)(招商安瑞进取债券)《中国基金报》

英华奖公募基金20年特别评选·公募基金20年最佳回报债券型基金 (纯债)(招商安心收益债券)《中国基金报》

英华奖公募基金20年特别评选·公募基金20年最佳回报债券型基金 (纯债)(招商信用添利债券(LOF))《中国基金报》

英华奖公募基金20年特别评选·公募基金20年 “最佳固定收益基金管理人”《中国基金报》

明星基金奖·五年持续回报积极债券型明星基金(招商安瑞进取债券)《证券时报》

明星基金奖·五年持续回报普通债券型明星基金 (招商产业债券)《证券时报》

明星基金奖·2017年度绝对收益明星基金(招商丰融混合)《证券时报》

Morningstar晨星(中国)2018年度普通债券型基金奖提名(招商安心收益债券)

金牛奖·五年期开放式债券型持续优胜金牛基金(招商产业债券)《中国证券报》

金基金奖·五年期债券基金奖(招商产业债券)《上海证券报》

公募基金20周年·“金基金”债券投资回报基金管理公司奖《上海证券报》

公募基金20周年·“金基金”行业领军人物奖(金旭)《上海证券报》

致敬基金20年·基金行业领军人物奖(金旭)《新浪》

致敬基金20年·最受投资者欢迎基金公司奖《新浪》

致敬基金20年·区域影响力奖 《新浪》

金牛奖·三年期海外金牛私募投资经理(多策略)《中国证券报》

中国金融科技先锋榜·2018中国AI金融先锋榜《证券时报》

中国金融科技先锋榜·2018年中国智能投顾新锐榜《证券时报》

金帆奖·2018年度基金管理公司《21世纪经济报道》

2018年度教育扶贫先锋企业《国际金融报》

金鼎奖·最具潜力基金公司《每日经济新闻》

离岸中资基金大奖·最具创意产品·香港中资基金业协会、彭博

中国网金融扶贫先锋榜·中国网精准扶贫先锋机构《中国网》

金砖奖·最佳资产配置奖《南方都市报》

金禧奖·2018最佳基金投研团队《投资时报》

腾讯理财通金企鹅奖·最佳债券基金奖·腾讯、晨星

中国金融金领带奖·年度卓越海外投资基金《华尔街见闻》

公募基金20周年行业特别评选·卓越影响力基金公司《界面·财联社》

公募基金20周年行业特别评选·最佳互联网金融服务基金公司 《界面·财联社》

金蝉奖·2018年度基金管理公司《华夏时报》

基情20年最受欢迎基金公司·东方财富、天天基金

天天基金6周年定投榜·东方财富、天天基金

2018年东方风云榜连续三年稳回报基金·东方财富、天天基金

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	-	12	男,管理学硕士,FRM、2006年加入招商基金管理有限公司,曾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、高级风险经理、主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作,曾任招商保证100指数证券投资基金、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金、深证电子信息特色产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息特色产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证煤炭等权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联接基金、招商中证国证芯片指数分级证券投资基金、招商中证国证芯片指数分级证券投资基金联接基金、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、招商稳健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、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商中证500指数增强型证券投资基金基金经理。

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.6343元,基金份额总额27,699,995.91份。

7.2 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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-5,479,042.66	-4,985,852.19
1.利息收入	11,218.97	39,283.95
其中:存款利息收入	11,218.91	37,702.85
债券利息收入	0.06	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	1,581.10
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-2,160,799.10	-6,687,428.77
其中:股票投资收益	-2,532,719.08	-7,002,998.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	371,919.98	315,569.47
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-3,341,505.98	1,523,084.04
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	12,043.45	139,208.59
减:二、费用	750,423.51	2,024,902.51
1.管理人报酬	334,956.91	692,331.74
2.托管费	55,826.12	115,388.56
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	160,245.48	859,287.57
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	-	-
7.其他费用	199,395.00	357,894.64
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-6,229,466.17	-7,010,754.70
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-6,229,466.17	-7,010,754.70

7.3 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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31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)	34,904,691.70	-4,766,966.44	30,137,725.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,229,466.17	-6,229,466.17
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)	-7,294,695.79	867,112.74	-6,337,583.05
其中:1.基金申购款	4,073,863.27	-860,232.53	3,213,630.74
2.基金赎回款	-11,278,559.06	1,727,345.27	-9,551,213.79
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(基金净值)	27,699,995.91	-10,129,319.87	17,570,676.04
项目	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31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)	-	-7,010,754.70	-7,010,754.70
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)	-47,659,581.01	3,649,558.11	-44,010,022.90
其中:1.基金申购款	11,692,464.96	-1,271,538.30	10,420,926.66
2.基金赎回款	-59,352,045.97	4,921,096.41	-54,430,949.56
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(基金净值)	34,904,691.70	-4,766,966.44	30,137,725.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

____金旭____ ____欧志明_____ _____何剑萍____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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》(以下简称“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。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(以下简称“民生银行”)。

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,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为沪深300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

7.4.2 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。

7.4.3 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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

报告期所采用的会计政策、会计估计与2017年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》 及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)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。

2)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。

3)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。

4)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。

5)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。

7.4.7 关联方关系

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
中国民生银行股份有限公司	基金托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
招商资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司

注: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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	334,956.91	692,331.74
其中:支付销售机构的客户维护费	103,747.44	217,037.12

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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	55,826.12	115,388.56

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 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

本报告期末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。

7.4.8.5 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2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	1,153,798.17	10,153.07	2,612,479.69	31,030.98

注:本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	1,000	3,140.00	3,140.00	-
7.4.9.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018年12月26日	2019年1月18日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

以上“可流通日”中,部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

7.4.9.2 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
600030	中信证券	2018年12月25日	重大事项	16.01	2019年1月10日	17.15	3,100	53,617.42	49,631.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

下表按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产工具于12月31日的账面价值。

单位:人民币元

资产	本期末(2018年12月31日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	16,534,481.23	52,771.00	-	16,587,252.23
债券投资	-	-	1,000.00	1,000.00
合计	16,534,481.23	52,771.00	1,000.00	16,588,252.23

单位:人民币元

资产	上年度末(2017年12月31日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	27,194,835.52	1,301,432.00	-	28,496,267.52
债券投资	-	-	-	-
合计	27,194,835.52	1,301,432.00	-	28,496,267.52

(ii)公允价值所属层次间的重大变动对于本基金投资的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	16,587,252.23	93.24
	其中:股票	16,587,252.23	93.24
2	固定收益投资	1,000.00	0.01
	其中:债券	1,000.00	0.01
	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	-	-
	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	1,196,120.30	6.72
7	其他资产	5,277.28	0.03
8	合计	17,789,649.81	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	180,272.00	1.03
B	采矿业	243,492.00	1.39
C	制造业	8,524,233.64	48.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	237,803.00	1.35
E	建筑业	310,198.00	1.77
F	批发和零售业	368,640.00	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,100,478.00	6.26
H	住宿和餐饮业	116,188.80	0.66
I	信息传输、软件和信息技术服务业	584,351.79	3.33
J	金融业	2,879,196.00	16.39
K	房地产业	913,162.00	5.20
L	租赁和商务服务业	614,097.00	3.50
M	科学研究和技术服务业	135,226.00	0.77
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	144,650.00	0.82
R	文化、体育和娱乐业	235,264.00	1.34
S	综合	-	-
	合计	16,587,252.23	94.40

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	9,700	544,170.00	3.10
2	000002	万科A	19,600	466,872.00	2.66
3	002304	洋河股份	4,300	407,296.00	2.32
4	002415	海康威视	14,422	371,510.72	2.11
5	601888	中国国旅	5,800	349,160.00	1.99
6	600132	重庆啤酒	11,300	347,249.00	1.98
7	601169	北京银行	61,700	346,137.00	1.97
8	600276	恒瑞医药	6,060	319,665.00	1.82
9	000423	东阿阿胶	8,000	316,400.00	1.80
10	601100	恒立液压	15,420	305,470.20	1.74

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于招商基金管理有限公司网站http://www.cmfchina.com上的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000333	美的集团	673,162.00	2.23
2	300124	汇川技术	629,984.32	2.09
3	601328	交通银行	619,284.00	2.05
4	300059	东方财富	530,810.00	1.76
5	601318	中国平安	520,024.00	1.73
6	300070	碧水源	507,996.00	1.69
7	000002	万科A	503,255.00	1.67
8	600276	恒瑞医药	498,515.00	1.65
9	600519	贵州茅台	496,179.00	1.65
10	601009	南京银行	483,537.68	1.60
11	002415	海康威视	479,710.37	1.59
12	000876	新希望	464,336.00	1.54
13	000858	五粮液	451,557.00	1.50
14	601166	兴业银行	442,659.00	1.47
15	601169	北京银行	442,657.00	1.47
16	000001	平安银行	441,900.00	1.47
17	002008	大族激光	440,981.76	1.46
18	002304	洋河股份	432,519.00	1.44
19	300136	信维通信	418,092.00	1.39
20	000423	东阿阿胶	392,560.68	1.30

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。

8.4.2 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	601318	中国平安	1,958,998.00	6.50
2	600519	贵州茅台	1,135,916.00	3.77
3	000333	美的集团	1,039,460.00	3.45
4	000651	格力电器	1,009,532.00	3.35
5	601328	交通银行	792,890.00	2.63
6	601288	农业银行	752,024.00	2.50
7	600000	浦发银行	721,374.00	2.39
8	000858	五粮液	626,762.00	2.08
9	600048	保利地产	573,559.00	1.90
10	300059	东方财富	570,786.60	1.89
11	601668	中国建筑	562,865.00	1.87
12	300124	汇川技术	560,548.00	1.86
13	601818	光大银行	546,836.00	1.81
14	600340	华夏幸福	541,178.00	1.80
15	600690	青岛海尔	539,284.00	1.79
16	000725	京东方A	529,268.00	1.76
17	601166	兴业银行	512,018.00	1.70
18	601601	中国太保	493,572.70	1.64
19	600104	上汽集团	491,242.00	1.63
20	002236	大华股份	480,384.00	1.59

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。

8.4.3 买入股票