

招商财经大数据策略股票型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

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8月26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。本基金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8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务计划报告、投资组合报告等内容，确认本基金不存在虚假记载、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。

本半年度报告摘要节录自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30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
基金代码	000416
交易方式	契约型开放式
基金经理	孙晓东
基金合同生效日	2016年11月12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

23,821,989.27份

基金类别

股票型基金

基金运作周期

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模型选股，在有效控制风险的前提下，力争获取超越基准指数的稳定收益，追求基金资产的长期增值。

投资策略

本基金主要通过行业配置、行业轮动、个股精选、择时操作等方法实

现对股票的配置。

风险收益特征

本基金是股票型基金，其预期收益和风险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

姓名 郑伟里 罗静

信息披露负责人 联系电话 0755-83196066 010-69560666

电子邮箱 csmfchina.com.tgb@zts.mocomecn

客户服务电话 400-887-9566 95668

传真 0755-83196476 010-69560798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告公告的管理人互联网网址 <http://www.csmfchina.com>

基金半年度报告备置地点 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

3.11 期间数据和指标		报告期(2019年1月1日～2019年6月30日)	
本期净收益	833,198.90	上年度末	2018年12月31日
本期利润	4,219,190.88		
加权平均基金份额本期利润	0.0653		
本期基金份额净增长率	24.28%		
3.12 期末数据和指标	报告期(2019年6月30日)		
期末基金份额净值	-0.2101		
期末基金份额净值	17,778,136.08		
期末基金份额净值	0.7893		

注：1、基金业绩指标不包括持有人认购（申购）或交易基金的各项费用，计价费用请详见相关法律法规；

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之和减去部分的预扣税数。

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(元)	份额增长率为		业绩比较基准(%)	差额(%)
		①-②	③-④		
过去一个月	4.83%	1.15%	4.43%	0.93%	0.40%
过去1个月	-1.76%	-1.48%	-0.72%	-1.22%	-0.46%
过去3个月	24.28%	1.47%	21.88%	1.24%	0.33%
过去一年	2.87%	1.51%	8.88%	1.22%	-0.62%
自基金合同生效至今	-21.17%	1.27%	13.66%	0.91%	-34.73%

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

图：招商财经大数据策略股票型证券投资基金与业绩比较基准的走势图

图例：本基金、业绩比较基准

图例：本基金、业绩比较基准