招商财富宝交易型货币市场基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	招商财富宝货币ETF
基金主代码	002852
交易代码	002852
基金运作方式	契约型、交易型开放式
基金合同生效日	2016年6月30日
报告期末基金份额总额	10,792,408,430.60份
投资目标	在兼顾基金资产的安全性和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以严谨的市场价值分析为基础,采用稳健的投资组合策略,通过对短期金融工具的组合操作,在保持本金的安全性与资产流动性的同时,追求稳定的当期收益。根据宏观经济指标、货币政策的研究,确定组合平均剩余到期期限; 根据各期限各品种的流动性、收益性以及信用水平来确定组合资产配置; 根据市场资金供给情况对组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整; 在保证组合流动性的前提下,利用现代金融分析方法和工具,寻找价值被低估的投资品种和无风险套利机会。 合理有效分配基金的现金流,保持本基金的流动性。 1、本基金主要投资策略的制定将依据以下投资方法和技术:收益率曲线研究、短期资金市场的资金供给与需求研究、企业信用分析、市场结构研究; 2、本基金具体操作策略:滚动配置策略、久期控制策略、套利策略、时机选择策略。
业绩比较基准	人民币活期存款基准利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	财富宝A / 财富宝E
下属分级基金的交易代码	002852 / 511850
报告期末下属分级基金的份额总额	10,288,338,320.25份 / 5,040,701.10份

注:本基金A级份额净值为1元,本基金E级份额净值为100元。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	财富宝A	财富宝E
1. 本期已实现收益	54,548,539.13	4,449,445.15
2.本期利润	54,548,539.13	4,449,445.15
3.期末基金资产净值	10,288,338,320.25	504,070,110.35

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,所以,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

财富宝A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9313%	0.0010%	0.0875%	0.0000%	0.8438%	0.0010%

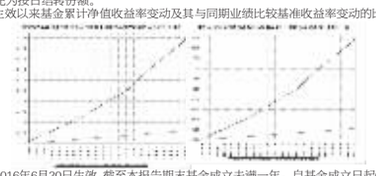
注:本基金收益分配为按日结转份额。

财富宝E

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9900%	0.0010%	0.0875%	0.0000%	0.9025%	0.0010%

注:本基金收益分配为按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同于2016年6月30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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
向霈	本基金的基金经理	2016年6月30日	-	11	女,工商管理硕士。2006年加入招商基金管理有限公司,先后曾任职于市场部、股票投资部、交易部;2011年起任固定收益投资部研究员,曾任招商现金增值开放式证券投资基金,招商理财7天债券型证券投资基金,招商招金宝货币市场基金及招商保证金快线货币市场基金基金经理,现任招商招钱宝货币市场基金,招商信用添利债券型证券投资基金(LOF),招商招利1个月期理财债券型证券投资基金,招商招益18个月定开债券型证券投资基金,招商财富宝交易型货币市场基金,招商中国信用机会定期开放债券型证券投资基金(QDII),招商招轩债券型证券投资基金及招商招泰6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
许强	本基金的基金经理	2016年6月30日	-	7	男,管理学学士。2006年9月加入华马威华振会计师事务所,从事审计工作,2010年9月加入招商基金管理有限公司,曾任基金核算部基金会计,固定收益投资部研究员,现任招商理财7天债券型证券投资基金,招商保证金快线货币市场基金,招商招金宝货币市场基金,招商招益债券型证券投资基金,招商理财增利债券型证券投资基金,招商财富宝交易型货币市场基金,招商招裕纯债债券型证券投资基金,招商招悦纯债债券型证券投资基金,招商招元纯债债券型证券投资基金,招商招天纯债债券型证券投资基金,招商招盛纯债债券型证券投资基金,招商招睿纯债债券型证券投资基金,招商招利纯债债券型证券投资基金,招商招惠纯债债券型证券投资基金,招商招辰纯债债券型证券投资基金,招商招丰纯债债券型证券投资基金,招商招顺纯债债券型证券投资基金,招商招祥纯债债券型证券投资基金,招商招旭纯债债券型证券投资基金,招商招华纯债债券型证券投资基金,招商招弘纯债债券型证券投资基金,招商招榕宝货币市场基金,招商招景纯债债券型证券投资基金,招商招信纯债债券型证券投资基金以及招商招享纯债债券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《招商财富宝交易型货币市场基金基金合同》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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年1季度经济平稳复苏,房地产、基建投资的环比改善。2月固定资产投资增速8.9%,其中房地产领域销售继续回落,但补库存效应下,房地产投资同比反弹到8.9%,新开工的增速走出过去2年的低迷。基建投资同比21.3%,对经济温和复苏起到了必要的支持作用。CPI受食品和成品油价格的拖累再创新低,而PPI也开始见顶。1季度非食品分项走势略低于季节性,处于历史中位水平,涨幅没有超出季节性因素。2017年1季度的货币政策以中性稳健为主,央行分别于1月24日和3月16日上调MLF和OMO的操作利率,并通过公开市场操作回笼资金,在维稳资金面、降低融资成本和经济结构调整的基础上,适度的打击金融市场的过度杠杆水平。3月底受MPA考核等因素影响,市场资金较为紧张,利率大幅上升。

报告期内本基金坚持一贯的以流动性、安全性为宗旨的原则,在提供充足流动性的同时,充分利用市场时机,提高组合收益弹性,为持有人创造了较好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A类份额净值收益率为0.9313%,E类份额净值收益率为0.9900%,同期业绩比较基准收益率为0.0875%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关要求,基金合同生效后,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露。

报告期内,本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,926,574,578.85	24.23
	其中:债券	2,926,574,578.85	24.23
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,130,704,416.06	25.91
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,969,379,485.91	49.41
4	其他资产	54,079,778.88	0.45
5	合计	12,080,738,259.70	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.20	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,283,147,155.26	11.89
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	29.23	11.89
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	16.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	27.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	6.3	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	32.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	111.44	11.89

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余存续期不得超过240天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	521,478,246.14	4.83
	其中:政策性金融债	521,478,246.14	4.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	49,972,300.69	0.46
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,355,124,032.02	21.82
8	其他	-	-
9	合计	2,926,574,578.85	27.12
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111717075	17光大银行CD075	7,000,000	684,544,587.97	6.34
2	111717073	17光大银行CD073	4,000,000	391,278,291.11	3.63
3	140220	14国开20	3,100,000	311,387,804.67	2.89
4	111711123	17平安银行CD123	3,000,000	296,780,994.92	2.75
5	111714115	17江苏银行CD115	3,000,000	293,566,614.03	2.72
6	111794712	17广州农村商业银行CD062	3,000,000	293,271,076.03	2.72
7	111715074	17民生银行CD074	2,000,000	197,837,892.04	1.83
8	111618315	16华夏CD315	1,000,000	98,922,651.78	0.92
9	150417	15农发17	800,000	80,099,373.96	0.74
10	160308	16进出08	700,000	69,802,981.61	0.65

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0175%
报告期内偏离度的最低值	-0.0021%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0068%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。

5.9.2

本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.9.3

报告期内基金投资的前十名证券除17平安银行CD123(证券代码111711123)、17民生银行CD074(证券代码111715074)外其他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。

17平安银行CD123(证券代码111711123)

根据中国银行间市场交易商协会2016年12月2日公告,公司作为债务融资工具主承销商,未能按照相关自律规则的规定及时披露公司重大资产无偿划转相关事项,依据相关自律规定,经2016年第9次自律处分会议审议,给予公司通报批评处分,责令公司立即纠正违规行为,并针对本次事件中暴露出的问题进行整改。

对该证券的投资决策程序的说明:本基金管理人认为该公司自身经营良好,且股东地位高,外部支持强。经过内部严格的投资决策流程,将该存单纳入实际投资组合。

17民生银行CD074(证券代码111715074)

2016年8月11日,北京证监局向公司下发《关于对中国民生银行股份有限公司的监管关注函》,要求公司完善公司治理结构,尽快落实独立董事的选举。

上海证券交易所于 2016 年 7 月 19 日向公司下发《关于中国民生银行股份有限公司股东增持事项的监管工作函》,要求公司督促股东披露增持公司股份有关事项,公司及时对上述事项进行了落实,并公告了股东增持的有关事项。

上海证券交易所于 2016 年 7 月 26 日向公司下发《关于中国民生银行股份有限公司加强规范运作的监管工作,对公司加强规范运作事项提出监管要求。公司已按照监管要求积极整改。

2016年10月10日,中国人民银行营业管理部发布行政处罚公示,公司因违反《征信业管理条例》相关规定被罚款40万元。

对该证券的投资决策程序的说明:本基金管理人认为该公司自身经营良好,且股东地位高,外部支持强。经过内部严格的投资决策流程,将该存单纳入实际投资组合。

5.9.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	32,687,838.48
4	应收申购款	21,391,940.40
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	54,079,778.88

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	财富宝A	财富宝E
报告期期初基金份额总额	2,095,152,712.48	4,820,620.84
报告期期间基金总申购份额	16,967,187,076.99	4,577,784.45
报告期期间基金总赎回份额	8,774,001,469.22	4,357,704.19
报告期末基金份额总额	10,288,338,320.25	5,040,701.10

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据基金管理人招商基金管理有限公司2017年2月10日发布的《招商基金管理有限公司关于招商财富宝交易型货币市场基金E类份额销售服务费优惠活动的公告》,自2017年2月10日起,招商财富宝货币基金ETF E的销售服务费按基金前一日的资产净值×0.01%的年费率来计提;

2、根据基金管理人招商基金管理有限公司2017年3月31日发布的《招商基金管理有限公司关于招商财富宝交易型货币市场基金A类份额销售服务费优惠活动的公告》,决定于2017年4月5日至2017年4月11日期间,招商财富宝货币基金ETF A的销售服务费按基金前一日的资产净值×0.01%的年费率来计提。

§9 备查文件目录

9.1 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富宝交易型货币市场基金设立的文件;

3、《招商财富宝交易型货币市场基金基金合同》;

4、《招商财富宝交易型货币市场基金托管协议》;

5、《招商财富宝交易型货币市场基金招募说明书》;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2 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

9.3 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4月21日

招商财经大数据策略股票型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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
报告送出日期:2017年4月21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。

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4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	招商财经大数据股票
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
报告期末基金份额总额	55,761,514.63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	本基金的投资策略包括:1、资产配置策略;2、股票投资策略;3、债券投资策略;4、资产支持证券投资策略;5、权证投资策略;6、中小企业私募债券投资策略;7、股指期货投资策略。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-1,936,023.89
2.本期利润	-3,852,453.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0538
4.期末基金资产净值	51,587,213.67
5.期末基金份额净值	0.9251

注:1、所述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;

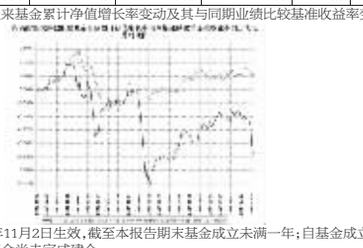
3、本基金合同于2016年11月2日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-5.89%	1.20%	3.46%	0.41%	-9.35%	0.79%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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,截至报告期末基金尚未完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王平	本基金的基金经理	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、金融工程研发等工作。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分级证券投资基金,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,招商中证500指数增强型证券投资基金及招商中证1000指数增强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 公平交易专项说明

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 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,以期望在控制风险的前提下增厚组合收益。

关于本基金的运作,报告期内投资运作较为稳定,股票仓位总体维持在91%左右的水平。

4.5 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-5.89%,同期业绩比较基准增长率为3.46%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关要求,基金合同生效后,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露。

报告期内,本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	47,266,766.01	90.47
	其中:股票	47,266,766.01	90.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,691,942.53	8.98
8	其他资产	285,173.91	0.55
9	合计	52,243,882.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,026,087.00	1.99
B	采矿业	1,023,335.00	1.98
C	制造业	35,300,794.08	68.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,981,066.93	3.84
E	建筑业	1,087,845.00	2.11
F	批发和零售业	937,064.00	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	934,654.00	1.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,083,693.00	2.10
J	金融业	1,886,626.00	3.66
K	房地产业	1,566,641.00	3.04
L	租赁和商务服务业	204,120.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	234,840.00	0.46
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	47,266,766.01	91.62

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

5.3 报告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	002740	爱迪尔	83,000	1,332,980.00	2.58
2	002248	华东数控	84,215	912,890.60	1.77
3	300387	富邦股份	32,557	867,644.05	1.68
4	601166	兴业银行	53,400	865,614.00	1.68
5	002598	山东章鼓	72,600	862,488.00	1.67
6	300394	天孚通信	27,800	816,486.00	1.58
7	000890	法尔胜	77,000	813,890.00	1.58
8	300472	新元科技	20,100	761,388.00	1.48
9	002207	准油股份	43,400	724,346.00	1.40
10	000880	潍柴重机	46,100	693,805.00	1.34

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除准油股份(股票代码002207)、华东数控(股票代码002248)外其他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。

1、准油股份(股票代码002207):

根据公司2016年10月19日的公告,公司收到《中国证券监督管理委员会监督检查通知书》,因公司涉嫌对外提供担保,证监会决定对公司进行调查。

根据公司2016年11月2日的公告,公司收到新疆证监局2016年10月31日签发的《中国证券监督管理委员会调查通知书》,因涉嫌违反证券法律法规,证监局决定对公司进行立案调查。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人认为,公司为油价上涨受益标的中的小市值品种。经过严格的投资决策过程,该股票被纳入实际投资组合

2、华东数控(股票代码002248):

根据公司2016年4月6日公告,因未依法及时履行关联交易审议程序和信息披露义务,公司于2016年4月1日收到山东证监局《关于对威海华东数控股份有限公司采取出具警示函措施的决定》。

2016年4月11日,公司因关联交易未按规定履行关联交易审议程序和信息披露义务,深交所下发《关于对威海华东数控股份有限公司的监管函》。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人认为公司的数控业务具备技术优势,公司在当前市值下,未来存在资产注入和资产运作空间。经过内部严格的投资决策流程,该股票被纳入实际投资组合。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	67,210.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,156.75
5	应收申购款	216,806.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	285,173.91

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002740	爱迪尔	1,332,980.00	2.58	重大事项
2	002248	华东数控	912,890.60	1.77	重大事项
3	300472	新元科技	761,388.00	1.48	重大事