

浙商汇金转型成长混合型证券投资基金2015年半年度报告

2015年6月30日

基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015年8月26日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会、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。本半年度报告已经过全部董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月25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。

浙江浙商证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、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2015年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §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                        | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 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遵规守信情况的说明              | 9  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 9  |
| 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             | 9  |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11 |
| §5 托管人报告                                | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 11 |
| 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 | 11 |
| 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      | 11 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 11 |
| 6.1 资产负债表                               | 11 |
| 6.2 利润表                                 | 13 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 14 |
| 6.4 报表附注                                | 15 |
| §7 投资组合报告                               | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 35 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 35 |
| 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       | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 42 |
| 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                           | 43 |
| §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.....   | 46 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变.....                | 46 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况.....         | 46 |
| 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..... | 46 |
| 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.....                   | 47 |
| §11  | 影响投资者决策的其他重要信息.....           | 50 |
| §12  | 备查文件目录.....                   | 50 |
| 12.1 | 备查文件目录.....                   | 50 |
| 12.2 | 存放地点.....                     | 50 |
| 12.3 | 查阅方式.....                     | 50 |

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 浙商汇金转型成长          |
| 基金主代码      | 000935            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2014年12月30日       |
| 基金管理人      | 浙江浙商证券资产管理有限公司    |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司        |
| 报告期末基金份额总额 | 515,398,081.95份   |
| 基金合同存续期    | 不定期               |

## 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要投资于与经济转型相关的上市公司，通过精选个股和严格控制风险，谋求基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略   | 本基金以中国经济结构转型及全新经济体系架构这一大趋势中不断涌现出来的行业个股为主要投资机会。就当前中国经济发展阶段及市场现状来看，目前经济转型相关的市场趋势包括但不限于：市场经济体制改革、资源价格改革、国企改革、金融市场化改革、财税体制改革、外贸改革、户籍改革、土地制度改革、国家安全建设、信息技术创新及装备升级、生态文明建设、教育、医疗、养老改革和创新等。同时，经济转型是一个长期动态的概念，本基金将根据中国经济结构转型进程的深入，动态调整投资主题的范畴界定。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于中高预期收益和风险水平的投资品种，预期风险和收益水平低于股票型基金，但高于债券型基金和货币型基金。   |

## 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      |      | 浙江浙商证券资产管理有限公司         | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 高玮                     | 王永民                  |
|         | 联系电话 | 0571-87901907          | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | gaowei@stocke.com.cn   | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 95345                  | 95566                |
| 传真      |      | 0571-87902581          | 010-66594942         |
| 注册地址    |      | 杭州市下城区天水巷25号           | 北京市西城区复兴门内大街1号       |
| 办公地址    |      | 杭州市西湖区杭大路1号黄龙世纪广场C座11楼 | 北京市西城区复兴门内大街1号       |
| 邮政编码    |      | 310007                 | 100818               |
| 法定代表人   |      | 吴承根                    | 田国立                  |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                      |
|----------------------|--------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《上海证券报》                              |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.stocke.com.cn                    |
| 基金半年度报告备置地点          | 浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场C座11楼浙江浙商证券资产管理有限公司 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址                   |
|--------|----------------|------------------------|
| 注册登记机构 | 浙江浙商证券资产管理有限公司 | 浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场C座11楼 |

## § 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

|                      |                           |
|----------------------|---------------------------|
| <b>3.1.1 期间数据和指标</b> | 报告期（2015年1月1日至2015年6月30日） |
| 本期已实现收益              | 459,988,551.83            |
| 本期利润                 | 586,037,182.10            |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.5809                    |
| 本期加权平均净值利润率          | 45.33%                    |
| 本期基金份额净值增长率          | 62.31%                    |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末(2015年6月30日)          |
| 期末可供分配利润             | 219,764,935.69            |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.4264                    |
| 期末基金资产净值             | 780,375,498.71            |
| 期末基金份额净值             | 1.514                     |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末(2015年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率          | 62.31%                    |

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利息收入、投资收益、其他收入（不包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，为期末资产负债表中分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金于2015年6月15日进行收益分配，向基金持有人每10份基金份额派发红利1.50元。分红后基金份额净值为2.058元人民币。

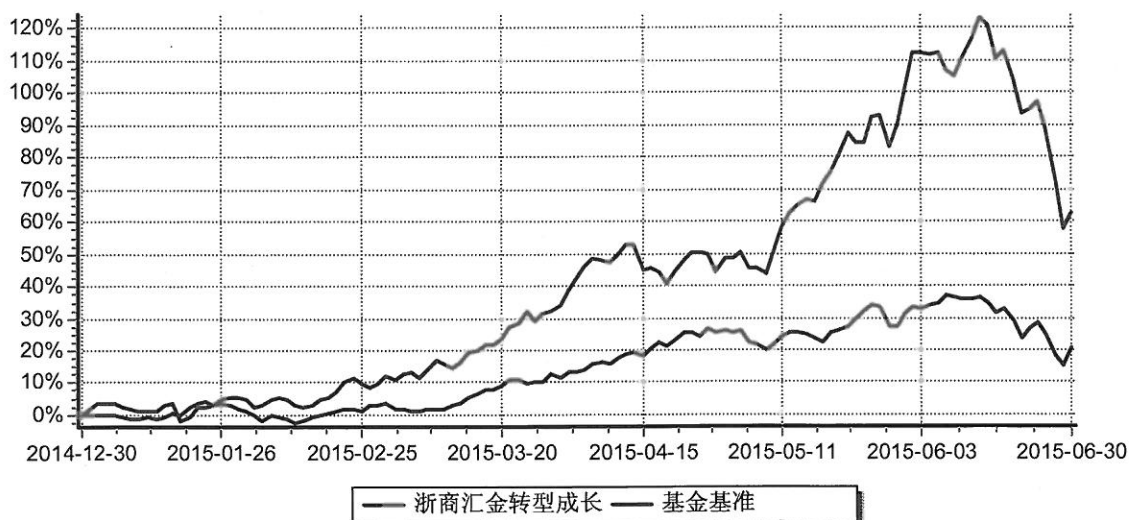
### 3.2 基金净值表现

#### 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     | -14.48%  | 4.09%       | -5.14%     | 2.44%         | -9.34% | 1.65% |
| 过去三个月     | 21.40%   | 3.20%       | 8.09%      | 1.83%         | 13.31% | 1.37% |
| 过去六个月     | 62.31%   | 2.47%       | 18.99%     | 1.58%         | 43.32% | 0.89% |
| 自基金合同生效日起 | 62.31%   | 2.45%       | 20.86%     | 1.57%         | 41.45% | 0.88% |

|                             |  |  |  |  |  |  |
|-----------------------------|--|--|--|--|--|--|
| 至今（2014年12月30日-2015年06月30日） |  |  |  |  |  |  |
|-----------------------------|--|--|--|--|--|--|

### 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变动的比较



注：本基金于2014年12月30日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金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

浙江浙商证券资产管理有限公司成立于2013年4月18日，是原浙商证券有限责任公司设立的全资子公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准浙商证券有限责任公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可（2012）1431号）批准，由浙商证券有限责任公司出资5亿元从事资产管理业务。2014年8月19日中国证券监督管理委员会批准《关于核准浙江浙商证券资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可（2014）857号）。公司主要经营范围涉及证券资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务。截止2015年6月30日，本基金管理人管理浙商汇金转型成长混合型证券投资基金。

#### 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期限 | 证券从 | 说明 |
|----|----|-------------|-----|----|
|----|----|-------------|-----|----|



|    |  | 任职日期            | 离任日期 | 业年限 |   |
|----|--|-----------------|------|-----|---|
| 李冬 | 本基金<br>经理、浙<br>江浙商<br>证券资<br>产管理<br>有限公<br>司公募<br>基金部<br>行政负<br>责人 | 2014年12月<br>30日 | —    | 7年  | 硕士，曾任浙商证券研究所和浙商证券资产管理部研究员、投资主办；浙商汇金大消费投资主办，浙商金惠新经济第三季投资主办；现任浙商汇金转型成长混合型证券投资基金的基金经理，并担任公募基金部行政负责人。 |

注：上述表格内基金经理的任职日期、离职日期均指公司作出决定并公告披露之日。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，浙江浙商证券资产管理有限公司作为浙商汇金转型成长混合型证券投资基金的管理人，严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《浙江浙商证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 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

2015年上半年，本产品显著跑赢了市场上除创业板外的主要指数，表现较为优异。尽管市场经历了大幅上涨以及急剧下跌，且市场的剧烈波动也导致了产品净值产生了较大幅度的波动，但是在对持仓品种进行积极管理的基础上，本产品依然取得了62.31%的半年收益率。2015年上半年，尽管宏观经济整体依然有较大的下行压力，但是充裕的流动性依然推动了市场的大幅上涨，本基金在投资管理过程中，始终坚定地投资于转型受益的相关领域。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金的份额净值增长率为62.31%，业绩比较基准收益率为18.99%，本基金大幅跑赢业绩比较基准。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年上半年，市场经历了连续的大幅上涨之后，出现了大幅震荡，尤其是6月下半个月，基于对短期流动性边际改变的预期，A股市场出现了大幅下挫，可以说在这个阶段是泥沙俱下，无论公司质地好坏，均无法避免系统性下跌，但是，从长期看，我们认为市场处于长期牛市的格局未变，依然看好长期的中国市场；从中短期看，风险急剧释放后，投资者信心的恢复需要一定时间，市场重新向上的格局较难在中短期内出现，市场可能走出分化格局，选择方向和精选个股尤为重要。对于我们而言，我们的投资始终围绕着这两个方向展开，通过自上而下的分析，选取未来具备大空间的细分领域；通过自下而上的分析，选取未来在潜在大市场的领域内寻找具备成为行业龙头潜质的企业。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定及我司估值政策和程序，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供

银行间同业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

本基金本报告期内实施的利润分配金额为93,562,218.87元。

### § 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在浙商汇金转型成长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：浙商汇金转型成长混合型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

| 资产   | 附注号     | 本期末<br>2015年6月30日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|------|---------|-------------------|---------------------|
| 资产：  |         |                   |                     |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 161,644,802.87    | 1,568,483,824.64    |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 结算备付金           |            | 3,220,615.30              | —                           |
| 存出保证金           |            | 854,093.41                | —                           |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 680,749,093.07            | 19,947.00                   |
| 其中：股票投资         |            | 680,749,093.07            | 19,947.00                   |
| 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    | —                         | 100,000.00                  |
| 应收证券清算款         |            | 45,834,047.98             | —                           |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 23,106.89                 | 62,739.36                   |
| 应收股利            |            | —                         | —                           |
| 应收申购款           |            | —                         | —                           |
| 递延所得税资产         |            | —                         | —                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | 110,493.05                | 110,493.05                  |
| 资产总计            |            | 892,436,252.57            | 1,568,777,004.05            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2014年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                           |                             |
| 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         |            | —                         | 120,077.11                  |
| 应付赎回款           |            | 109,240,171.55            | —                           |
| 应付管理人报酬         |            | 1,452,789.83              | 64,464.07                   |
| 应付托管费           |            | 242,131.64                | 10,744.01                   |
| 应付销售服务费         |            | —                         | —                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 894,970.08                | 18.27                       |

|               |          |                |                  |
|---------------|----------|----------------|------------------|
| 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  | 230,690.76     | —                |
| 负债合计          |          | 112,060,753.86 | 195,303.46       |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 515,398,081.95 | 1,568,594,317.69 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 264,977,416.76 | -12,617.10       |
| 所有者权益合计       |          | 780,375,498.71 | 1,568,581,700.59 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 892,436,252.57 | 1,568,777,004.05 |

注：(1)本基金于2014年12月30日成立。

(2)报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.514元，基金份额总额515,398,081.95份。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商汇金转型成长混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------------|----------|------------------------|
| <b>一、收入</b>      |          | 613,004,275.24         |
| 1.利息收入           |          | 2,380,863.14           |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.11 | 972,757.88             |
| 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       |          | 1,408,105.26           |
| 其他利息收入           |          | —                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 474,197,777.10         |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.12 | 472,639,679.93         |

|                                 |          |                |
|---------------------------------|----------|----------------|
| 基金投资收益                          |          | —              |
| 债券投资收益                          |          | —              |
| 资产支持证券投资收<br>益                  |          | —              |
| 贵金属投资收益                         |          | —              |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.13 | —              |
| 股利收益                            | 6.4.7.14 | 1,558,097.17   |
| 3.公允价值变动收益（损失以<br>“-”号填列）       | 6.4.7.15 | 126,048,630.27 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号<br>填列）           |          | —              |
| 5.其他收入（损失以“-”号<br>填列）           | 6.4.7.16 | 10,377,004.73  |
| <b>减：二、费用</b>                   |          | 26,967,093.14  |
| 1. 管理人报酬                        |          | 9,748,573.20   |
| 2. 托管费                          |          | 1,624,762.24   |
| 3. 销售服务费                        |          | —              |
| 4. 交易费用                         | 6.4.7.17 | 15,491,505.53  |
| 5. 利息支出                         |          | —              |
| 其中：卖出回购金融资产支出                   |          | —              |
| 6. 其他费用                         | 6.4.7.18 | 102,252.17     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”<br/>号填列）</b> |          | 586,037,182.10 |
| 减：所得税费用                         |          | —              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |          | 586,037,182.10 |

注：(1)本基金于2014年12月30日成立，无上半年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金转型成长混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日


单位：人民币元

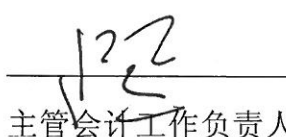
| 项 目                                    | 本期                   |                 |                   |
|--|----------------------|-----------------|-------------------|
|  | 2015年1月1日至2015年6月30日 |                 |                   |
|  | 实收基金                 | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 1,568,594,317.69     | -12,617.10      | 1,568,581,700.59  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | —                    | 586,037,182.10  | 586,037,182.10    |
| 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)      | -1,053,196,235.74    | -227,484,929.37 | -1,280,681,165.11 |
| 其中：1.基金申购款                             | 802,111,264.08       | 469,874,172.41  | 1,271,985,436.49  |
| 2.基金赎回款                                | -1,855,307,499.82    | -697,359,101.78 | -2,552,666,601.60 |
| 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) | —                    | -93,562,218.87  | -93,562,218.87    |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 515,398,081.95       | 264,977,416.76  | 780,375,498.71    |

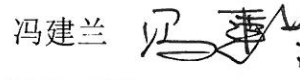
注：(1)本基金于2014年12月30日成立，无上半年度可比期间数据。

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：

李雪峰   
基金管理人负责人

盛建龙   
主管会计工作负责人

冯建兰   
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

浙商汇金转型成长混合型证券投资基金(简称“本基金”)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[2014]1271号)《关于准予浙商汇金转型成长混合型证券投资基金注册的批复》批准,由浙江浙商证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金基金合同》向社会公开发行募集。《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金基金合同》于2014年12

月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,568,594,317.69份基金份额，相关募集业经北京兴华会计师事务所 [2014]京会兴浙分验字第68000046号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。基金管理人为浙江浙商证券资产管理有限公司，注册登记机构为浙江浙商证券资产管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)并参照《证券投资基金会计核算业务指引》及《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金合同》的规定而编制的。

本财务报表以持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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

本基金合同生效日为2014年12月30日，无上年度同期对比数据。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。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,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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指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。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 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,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。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。

对于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;对于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。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、衍生工具等金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但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,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定

公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账;
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;
- (3) 买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在证券回购期内逐日计提;
- (4) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(5) 债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(6) 基金投资收益/(损失)于卖出基金成交日确认,并按卖出基金成交金额与其成本的差额入账;

(7) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除个人所得税后的净额入账;

(8) 公允价值变动收益/(损失)系本集合计划持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(9) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期费用。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即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;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、投资者的现金红利保留到小数点后第2位,此误差产生的收益或损失由基金资产承担;

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的

交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税。持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息、红利收入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,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税,暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

#### 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<br>2015年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 161,644,802.87    |
| 定期存款         | —                 |
| 其中:存款期限1-3个月 | —                 |
| 其他存款         | —                 |

|    |                |
|----|----------------|
| 合计 | 161,644,802.87 |
|----|----------------|

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末 2015年6月30日 |                |                |
|---------------|-------|----------------|----------------|----------------|
|               |       | 成本             | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 554,700,590.80 | 680,749,093.07 | 126,048,502.27 |
| 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            |       | 554,700,590.80 | 680,749,093.07 | 126,048,502.27 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末，未持有任何衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金于本报告期末，未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末，未持有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<br>2015年6月30日 |
|----------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 21,277.62         |
| 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  | 1,444.97  |
| 应收债券利息     | —         |
| 应收买入返售证券利息 | —         |
| 应收申购款利息    | —         |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —         |
| 其他         | 384.30    |
| 合计         | 23,106.89 |

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2015年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 其他应收款 | 110,493.05        |
| 待摊费用  | —                 |
| 合计    | 110,493.05        |

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 894,970.08        |
| 银行间市场应付交易费用 | —                 |
| 合计          | 894,970.08        |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                 |
| 应付赎回费       | 205,895.57        |
| 预提费用        | 24,795.19         |
| 合计          | 230,690.76        |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期2015年1月1日至2015年6月30日 |                   |
|---------------|------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                | 账面金额              |
| 上年度末          | 1,568,594,317.69       | 1,568,594,317.69  |
| 本期申购          | 802,111,264.08         | 802,111,264.08    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,855,307,499.82      | -1,855,307,499.82 |
| 本期末           | 515,398,081.95         | 515,398,081.95    |

注：申购含红利再投资份额13,077,880.74.

### 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           | -12,489.10      | -128.00         | -12,617.10      |
| 本期利润           | 459,988,551.83  | 126,048,630.27  | 586,037,182.10  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -146,648,908.17 | -80,836,021.20  | -227,484,929.37 |
| 其中：基金申购款       | 218,509,787.22  | 251,364,385.19  | 469,874,172.41  |
| 基金赎回款          | -365,158,695.39 | -332,200,406.39 | -697,359,101.78 |
| 本期已分配利润        | -93,562,218.87  | —               | -93,562,218.87  |
| 本期末            | 219,764,935.69  | 45,212,481.07   | 264,977,416.76  |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------|------------------------|
| 活期存款利息收入  | 838,391.73             |
| 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 | 129,365.70             |
| 其他        | 5,000.45               |
| 合计        | 972,757.88             |

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                   | 本期2015年1月1日至2015年6月30日 |
|----------------------|------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票<br>差价收入 | 472,639,679.93         |
| 股票投资收益——赎回差价<br>收入   | —                      |
| 合计                   | 472,639,679.93         |

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 5,061,549,731.10           |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,588,910,051.17           |
| 买卖股票差价收入   | 472,639,679.93             |

### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期末无衍生工具收益。

### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,558,097.17               |
| 基金投资产生的股利收益 | —                          |
| 合计          | 1,558,097.17               |

### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|    |    |



|            | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------|----------------------|
| 1.交易性金融资产  | 126,048,630.27       |
| ——股票投资     | 126,048,630.27       |
| ——债券投资     | —                    |
| ——资产支持证券投资 | —                    |
| ——基金投资     | 0                    |
| ——贵金属投资    | —                    |
| ——其他       | —                    |
| 2.衍生工具     | —                    |
| ——权证投资     | —                    |
| 3.其他       | —                    |
| 合计         | 126,048,630.27       |

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 10,377,004.73              |
| 合计      | 10,377,004.73              |

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 15,491,505.53              |
| 银行间市场交易费用 | —                          |
| 合计        | 15,491,505.53              |

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|    |    |

|       | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-------|----------------------|
| 审计费用  | 74,795.19            |
| 信息披露费 | —                    |
| 其他    | 200.00               |
| 汇划手续费 | 27,256.98            |
| 合计    | 102,252.17           |

#### 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

截止本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务批准报出日，本基金未发生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

本报告期存在控制关系或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             |
|----------------|---------------------|
| 浙江浙商证券资产管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 浙商证券股份有限公司     | 基金管理人的母公司、本基金销售机构   |
| 中国银行股份有限公司     | 基金托管人、本基金销售机构       |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                   |              |
|-------|----------------------|--------------|
|       | 2015年1月1日至2015年6月30日 |              |
|       | 成交金额                 | 占当期股票成交总额的比例 |
|       |                      |              |

|                |                   |         |
|----------------|-------------------|---------|
| 浙商证券股份<br>有限公司 | 10,202,251,985.82 | 100.00% |
|----------------|-------------------|---------|

注：本基金合同生效日为2014年12月30日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期末，未发生权证交易。并且基金合同生效日为2014年12月30日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                |              |                  |
|----------------|----------------------------|----------------|--------------|------------------|
|                | 当期佣金                       | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金<br>余额 | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 浙商证券股份<br>有限公司 | 9,288,111.87               | 100.00%        | 894,970.08   | 100.00%          |

注：本基金合同生效日为2014年12月30日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.4 债券交易

本基金于本报告期末，未发生债券交易。并且基金合同生效日为2014年12月30日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期2015年1月1日至2015年6月30日 |                |
|-------|------------------------|----------------|
|       | 成交金额                   | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 浙商证券  | 18,740,100,000.00      | 100.00%        |

#### 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<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|----|----------------------------|
|    |                            |

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 9,748,573.20 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | —            |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,624,762.24               |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金于本报告期末，未产生销售服务费。并且基金合同生效日为2014年12月30日，无上年度同期对比数据。

#### 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

本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易的情况，并且基金合同生效日为2014年12月30日，无上年度同期对比数据。

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

本基金的基金管理人在本报告期间内未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。

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<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |            |
|----------|----------------------------|------------|
|          | 期末余额                       | 当期利息收入     |
| 中国银行活期存款 | 161,644,802.87             | 838,391.73 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日  | 除息日                       |                           | 每10份基金<br>份额分红数 | 现金形<br>式<br>发放总<br>额 | 再投资形式<br>发放总额 | 利润分<br>配<br>合计 | 备注 |
|----|------------|---------------------------|---------------------------|-----------------|----------------------|---------------|----------------|----|
|    |            | 2015<br>-6-15<br>(场<br>内) | 2015<br>-6-15<br>(场<br>外) |                 |                      |               |                |    |
| 1  | 2015-06-15 | 2015-6-15<br>(场内)         | 2015-6-15<br>(场外)         | 1.500           | 67,877,260.23        | 25,684,958.64 | 93,562,218.87  |    |
| 合计 |            |                           |                           | 1.500           | 67,877,260.23        | 25,684,958.64 | 93,562,218.87  |    |

6.4.12 期末（2015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**

截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

**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        | 期末成本总额        | 期末估值总额        |
|--------|------|------------|------|--------|------|--------|-----------|---------------|---------------|
| 002183 | 怡亚通  | 2015-06-01 | 重大事项 | 73.15  |      | —      | 1,035,569 | 39,374,345.59 | 75,751,872.35 |

**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**

截至本报告期末，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金管理人按照全面风险管理的要求，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

公司建立了“董事会—经营管理层—合规风控部”三级风险管理体系，董事会主要负责设定公司的风险偏好和制订风险管理授权体系；公司经营层主要负责执行经董事会批准的风险管理政策；合规风控部门具体履行合规与风险管理职能，对各类风险进行评估和动态监控。

**6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险较小。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。本基金在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,以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足,无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足,导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,所持大部分证券在证券交易所上市,期末除6.4.12列示券种流通暂时受限制不能自由转让外,其余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

| 本期末<br>2015年6月<br>30日 | 1个月以<br>内          | 1-3个月 | 3个月<br>-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息                | 合计                 |
|-----------------------|--------------------|-------|------------|------|------|--------------------|--------------------|
| 资产                    |                    |       |            |      |      |                    |                    |
| 银行存款                  | 161,644,<br>802.87 | —     | —          | —    | —    | —                  | 161,644,<br>802.87 |
| 结算备付金                 | 3,220,61<br>5.30   | —     | —          | —    | —    | —                  | 3,220,61<br>5.30   |
| 存出保证金                 | 854,093.<br>41     | —     | —          | —    | —    | —                  | 854,093.<br>41     |
| 交易性金融<br>资产           | —                  | —     | —          | —    | —    | 680,749,<br>093.07 | 680,749,<br>093.07 |
| 应收证券清<br>算款           | —                  | —     | —          | —    | —    | 45,846,4<br>09.16  | 45,846,4<br>09.16  |

|                         |                  |       |        |      |      |                |                  |
|-------------------------|------------------|-------|--------|------|------|----------------|------------------|
| 应收利息                    | —                | —     | —      | —    | —    | 23,106.89      | 23,106.89        |
| 其他资产                    | —                | —     | —      | —    | —    | 110,493.05     | 110,493.05       |
| 资产总计                    | 165,719,511.58   | —     | —      | —    | —    | 726,729,102.17 | 892,448,613.75   |
| 负债                      |                  |       |        |      |      |                |                  |
| 应付赎回款                   | —                | —     | —      | —    | —    | 109,240,171.55 | 109,240,171.55   |
| 应付管理人报酬                 | —                | —     | —      | —    | —    | 1,452,789.83   | 1,452,789.83     |
| 应付托管费                   | —                | —     | —      | —    | —    | 242,131.64     | 242,131.64       |
| 应付交易费用                  | —                | —     | —      | —    | —    | 894,970.08     | 894,970.08       |
| 其他负债                    | —                | —     | —      | —    | —    | 230,690.76     | 230,690.76       |
| 负债总计                    | —                | —     | —      | —    | —    | 112,060,753.86 | 112,060,753.86   |
| 利率敏感度缺口                 | 165,719,511.58   | —     | —      | —    | —    | 614,668,348.31 | 780,387,859.89   |
| 上年度末<br>2014年12月<br>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                    | 1,568,483,824.64 | —     | —      | —    | —    | —              | 1,568,483,824.64 |
| 交易性金融资产                 | —                | —     | —      | —    | —    | 19,947.00      | 19,947.00        |
| 买入返售金融资产                | 100,000.00       | —     | —      | —    | —    | —              | 100,000.00       |
| 应收利息                    | —                | —     | —      | —    | —    | 62,739.36      | 62,739.36        |
| 其他资产                    | —                | —     | —      | —    | —    | 110,493.05     | 110,493.05       |



|         |                  |   |   |   |   |            |                  |
|---------|------------------|---|---|---|---|------------|------------------|
|         |                  |   |   |   |   | 05         | 05               |
| 资产总计    | 1,568,583,824.64 | — | — | — | — | 193,179.41 | 1,568,777,004.05 |
| 负债      |                  |   |   |   |   |            |                  |
| 应付证券清算款 | —                | — | — | — | — | 120,077.11 | 120,077.11       |
| 应付管理人报酬 | —                | — | — | — | — | 64,464.07  | 64,464.07        |
| 应付托管费   | —                | — | — | — | — | 10,744.01  | 10,744.01        |
| 应付交易费用  | —                | — | — | — | — | 18.27      | 18.27            |
| 负债总计    | —                | — | — | — | — | 195,303.46 | 195,303.46       |
| 利率敏感度缺口 | 1,568,583,824.64 | — | — | — | — | -2,124.05  | 1,568,581,700.59 |

注：本基金于2014年12月30日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 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<br>2015年6月30日           | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|    | 1、市场利率增加0.25% | —                           | —                   |
|    | 2、市场利率降低0.25% | —                           | —                   |

注：本报告期末和上年度末，本基金未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险,主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的

其他市场价格风险,主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响,由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

| 项目           | 本期末<br>2015年6月30日 |                          | 上年度末<br>2014年12月31日 |                          |
|--------------|-------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|              | 公允价值              | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 680,749,093.07    | 87.23                    | 19,947.00           | —                        |
| 衍生金融资产—权证投资  | —                 | —                        | —                   | —                        |
| 其他           | —                 | —                        | —                   | —                        |
| 合计           | 680,749,093.07    | 87.23                    | 19,947.00           | —                        |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准指数(300指数)发生变动,其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。 |                             |                     |
|----|---|-----------------------------|---------------------|
| 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<br>2015年6月30日           | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|    | 1、沪深300指数上涨1%                               | 5,514,067.65                | 161.57              |
|    | 2、沪深300指数下跌1%                               | -5,514,067.65               | -161.57             |

注:本基金于2014年12月30日成立,无上年度可比期间数据。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 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（元）          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 680,749,093.07 | 76.28        |
|    | 其中：股票             | 680,749,093.07 | 76.28        |
| 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          | —              | —            |
|    | 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      | 164,865,418.17 | 18.47        |
| 7  | 其他各项资产            | 46,821,741.33  | 5.25         |
| 8  | 合计                | 892,436,252.57 | 100.00       |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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         | —              | —            |
| B  | 采矿业              | —              | —            |
| C  | 制造业              | 396,786,514.80 | 50.85        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 267,010.00     | 0.03         |
| E  | 建筑业              | 13,410.00      | —            |
| F  | 批发和零售业           | 85,426,448.38  | 10.95        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —              | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 53,331,780.28  | 6.83         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业           | 274,720.00     | 0.04  |
| K | 房地产业          | —              | —     |
| L | 租赁和商务服务业      | 111,843,052.43 | 14.33 |
| 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     | 32,806,157.18  | 4.20  |
| S | 综合            | —              | —     |
|   | 合计            | 680,749,093.07 | 87.23 |

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(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 002183 | 怡亚通  | 1,035,569 | 75,751,872.35 | 9.71         |
| 2  | 002089 | 新海宜  | 2,205,984 | 51,664,145.28 | 6.62         |
| 3  | 300232 | 洲明科技 | 1,849,370 | 51,227,549.00 | 6.56         |
| 4  | 300165 | 天瑞仪器 | 1,251,968 | 43,530,927.36 | 5.58         |
| 5  | 300049 | 福瑞股份 | 472,066   | 42,481,219.34 | 5.44         |
| 6  | 300329 | 海伦钢琴 | 1,092,884 | 38,250,940.00 | 4.90         |
| 7  | 300345 | 红宇新材 | 891,314   | 37,898,671.28 | 4.86         |
| 8  | 600358 | 国旅联合 | 2,118,027 | 36,091,180.08 | 4.62         |
| 9  | 601801 | 皖新传媒 | 1,124,654 | 32,806,157.18 | 4.20         |
| 10 | 600628 | 新世界  | 1,792,930 | 30,031,577.50 | 3.85         |
| 11 | 600682 | 南京新百 | 765,096   | 28,714,052.88 | 3.68         |
| 12 | 600865 | 百大集团 | 1,364,050 | 26,680,818.00 | 3.42         |
| 13 | 603766 | 隆鑫通用 | 1,021,440 | 25,638,144.00 | 3.29         |
| 14 | 300140 | 启源装备 | 611,848   | 24,339,313.44 | 3.12         |
| 15 | 002279 | 久其软件 | 426,822   | 22,834,977.00 | 2.93         |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 16 | 600557 | 康缘药业 | 716,600 | 19,942,978.00 | 2.56 |
| 17 | 000733 | 振华科技 | 676,290 | 18,253,067.10 | 2.34 |
| 18 | 002347 | 泰尔重工 | 681,800 | 16,670,010.00 | 2.14 |
| 19 | 600572 | 康恩贝  | 710,600 | 16,130,620.00 | 2.07 |
| 20 | 300059 | 东方财富 | 241,800 | 15,255,162.00 | 1.95 |
| 21 | 300168 | 万达信息 | 310,294 | 15,241,641.28 | 1.95 |
| 22 | 601777 | 力帆股份 | 680,000 | 10,737,200.00 | 1.38 |
| 23 | 601211 | 国泰君安 | 8,000   | 274,720.00    | 0.04 |
| 24 | 601985 | 中国核电 | 19,000  | 248,330.00    | 0.03 |
| 25 | 002767 | 先锋电子 | 500     | 21,730.00     | —    |
| 26 | 601368 | 绿城水务 | 1,000   | 18,680.00     | —    |
| 27 | 002775 | 文科园林 | 500     | 13,410.00     | —    |

#### 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  | 002407 | 多氟多  | 87,881,782.78 | 5.60           |
| 2  | 002332 | 仙琚制药 | 74,944,748.02 | 4.78           |
| 3  | 002610 | 爱康科技 | 74,569,944.96 | 4.75           |
| 4  | 600120 | 浙江东方 | 67,594,361.43 | 4.31           |
| 5  | 600767 | 运盛医疗 | 61,092,190.31 | 3.89           |
| 6  | 300065 | 海兰信  | 60,868,414.92 | 3.88           |
| 7  | 600118 | 中国卫星 | 60,565,136.20 | 3.86           |
| 8  | 000728 | 国元证券 | 58,764,577.86 | 3.75           |
| 9  | 300232 | 洲明科技 | 58,069,842.85 | 3.70           |
| 10 | 600895 | 张江高科 | 57,958,418.13 | 3.69           |
| 11 | 300212 | 易华录  | 55,126,289.63 | 3.51           |
| 12 | 002099 | 海翔药业 | 55,107,202.64 | 3.51           |
| 13 | 300049 | 福瑞股份 | 53,937,652.82 | 3.44           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 14 | 600109 | 国金证券 | 53,477,890.48 | 3.41 |
| 15 | 600309 | 万华化学 | 53,299,735.46 | 3.40 |
| 16 | 002178 | 延华智能 | 51,830,088.33 | 3.30 |
| 17 | 002488 | 金固股份 | 51,200,324.17 | 3.26 |
| 18 | 002462 | 嘉事堂  | 49,931,446.08 | 3.18 |
| 19 | 300226 | 上海钢联 | 49,739,265.32 | 3.17 |
| 20 | 000951 | 中国重汽 | 49,064,097.34 | 3.13 |
| 21 | 300150 | 世纪瑞尔 | 48,869,198.27 | 3.12 |
| 22 | 600358 | 国旅联合 | 48,654,523.04 | 3.10 |
| 23 | 600557 | 康缘药业 | 47,792,426.19 | 3.05 |
| 24 | 300011 | 鼎汉技术 | 47,756,984.45 | 3.04 |
| 25 | 600498 | 烽火通信 | 47,736,160.17 | 3.04 |
| 26 | 300038 | 梅泰诺  | 47,004,629.44 | 3.00 |
| 27 | 000425 | 徐工机械 | 46,944,612.01 | 2.99 |
| 28 | 002382 | 蓝帆医疗 | 46,714,904.23 | 2.98 |
| 29 | 601777 | 力帆股份 | 46,608,645.65 | 2.97 |
| 30 | 600202 | 哈空调  | 46,153,331.60 | 2.94 |
| 31 | 002339 | 积成电子 | 45,696,345.00 | 2.91 |
| 32 | 002279 | 久其软件 | 45,197,660.11 | 2.88 |
| 33 | 601318 | 中国平安 | 44,840,293.01 | 2.86 |
| 34 | 300140 | 启源装备 | 44,793,244.12 | 2.86 |
| 35 | 300165 | 天瑞仪器 | 44,558,482.04 | 2.84 |
| 36 | 300220 | 金运激光 | 44,419,613.15 | 2.83 |
| 37 | 300332 | 天壕节能 | 44,313,289.56 | 2.83 |
| 38 | 002051 | 中工国际 | 43,740,213.52 | 2.79 |
| 39 | 300204 | 舒泰神  | 43,538,403.94 | 2.78 |
| 40 | 300329 | 海伦钢琴 | 43,529,219.04 | 2.78 |
| 41 | 300325 | 德威新材 | 42,721,508.92 | 2.72 |
| 42 | 603308 | 应流股份 | 41,967,237.60 | 2.68 |
| 43 | 002347 | 泰尔重工 | 41,669,144.16 | 2.66 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 44 | 601801 | 皖新传媒 | 41,548,613.86 | 2.65 |
| 45 | 600290 | 华仪电气 | 41,538,540.11 | 2.65 |
| 46 | 002072 | 凯瑞德  | 41,381,208.10 | 2.64 |
| 47 | 600259 | 广晟有色 | 41,071,955.97 | 2.62 |
| 48 | 002496 | 辉丰股份 | 40,800,819.09 | 2.60 |
| 49 | 002183 | 怡亚通  | 40,683,479.11 | 2.59 |
| 50 | 300005 | 探路者  | 40,252,088.21 | 2.57 |
| 51 | 002516 | 江苏旷达 | 40,023,236.50 | 2.55 |
| 52 | 300353 | 东土科技 | 39,999,641.57 | 2.55 |
| 53 | 002438 | 江苏神通 | 39,962,511.50 | 2.55 |
| 54 | 002089 | 新海宜  | 39,317,447.38 | 2.51 |
| 55 | 600369 | 西南证券 | 38,967,960.00 | 2.48 |
| 56 | 300050 | 世纪鼎利 | 38,385,423.58 | 2.45 |
| 57 | 300147 | 香雪制药 | 38,383,678.15 | 2.45 |
| 58 | 300377 | 赢时胜  | 37,881,403.48 | 2.42 |
| 59 | 002184 | 海得控制 | 36,215,731.57 | 2.31 |
| 60 | 002052 | 同洲电子 | 35,858,811.46 | 2.29 |
| 61 | 600271 | 航天信息 | 35,600,992.22 | 2.27 |
| 62 | 002282 | 博深工具 | 35,345,645.48 | 2.25 |
| 63 | 002690 | 美亚光电 | 35,171,515.02 | 2.24 |
| 64 | 600026 | 中海发展 | 34,971,098.49 | 2.23 |
| 65 | 300034 | 钢研高纳 | 34,860,971.65 | 2.22 |
| 66 | 600628 | 新世界  | 34,537,967.23 | 2.20 |
| 67 | 002139 | 拓邦股份 | 34,479,030.99 | 2.20 |
| 68 | 600682 | 南京新百 | 34,361,184.18 | 2.19 |
| 69 | 300130 | 新国都  | 34,113,215.40 | 2.17 |
| 70 | 600149 | 廊坊发展 | 33,997,829.36 | 2.17 |
| 71 | 002318 | 久立特材 | 33,200,074.94 | 2.12 |
| 72 | 002588 | 史丹利  | 33,143,055.64 | 2.11 |
| 73 | 002373 | 千方科技 | 32,888,266.74 | 2.10 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 74 | 600869 | 智慧能源 | 32,579,571.52 | 2.08 |
| 75 | 300072 | 三聚环保 | 31,650,000.00 | 2.02 |
| 76 | 300139 | 福星晓程 | 31,534,961.54 | 2.01 |

注：表中“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  | 002610 | 爱康科技 | 96,308,048.24 | 6.14           |
| 2  | 002178 | 延华智能 | 94,516,184.00 | 6.03           |
| 3  | 300038 | 梅泰诺  | 92,595,590.32 | 5.90           |
| 4  | 002407 | 多氟多  | 88,094,909.56 | 5.62           |
| 5  | 300065 | 海兰信  | 74,271,213.05 | 4.73           |
| 6  | 002332 | 仙琚制药 | 67,644,524.96 | 4.31           |
| 7  | 002099 | 海翔药业 | 67,431,555.61 | 4.30           |
| 8  | 600895 | 张江高科 | 65,698,891.53 | 4.19           |
| 9  | 600120 | 浙江东方 | 64,951,552.79 | 4.14           |
| 10 | 002382 | 蓝帆医疗 | 62,212,619.55 | 3.97           |
| 11 | 600767 | 运盛医疗 | 61,658,166.11 | 3.93           |
| 12 | 000728 | 国元证券 | 61,095,212.75 | 3.89           |
| 13 | 300212 | 易华录  | 59,916,057.93 | 3.82           |
| 14 | 002339 | 积成电子 | 58,225,716.24 | 3.71           |
| 15 | 600118 | 中国卫星 | 58,040,793.65 | 3.70           |
| 16 | 002488 | 金固股份 | 58,024,065.98 | 3.70           |
| 17 | 300011 | 鼎汉技术 | 57,902,538.87 | 3.69           |
| 18 | 300049 | 福瑞股份 | 57,603,801.65 | 3.67           |
| 19 | 002072 | 凯瑞德  | 57,132,990.20 | 3.64           |
| 20 | 600682 | 南京新百 | 55,952,768.32 | 3.57           |
| 21 | 002496 | 辉丰股份 | 52,957,139.66 | 3.38           |
| 22 | 300226 | 上海钢联 | 52,552,542.48 | 3.35           |



|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 23 | 600109 | 国金证券 | 52,103,418.73 | 3.32 |
| 24 | 002690 | 美亚光电 | 51,975,911.60 | 3.31 |
| 25 | 002282 | 博深工具 | 51,444,641.98 | 3.28 |
| 26 | 002516 | 江苏旷达 | 50,749,426.92 | 3.24 |
| 27 | 600309 | 万华化学 | 50,502,645.60 | 3.22 |
| 28 | 300005 | 探路者  | 49,453,940.30 | 3.15 |
| 29 | 000425 | 徐工机械 | 48,231,781.15 | 3.07 |
| 30 | 600271 | 航天信息 | 48,062,705.59 | 3.06 |
| 31 | 300332 | 天壕节能 | 46,891,151.12 | 2.99 |
| 32 | 601777 | 力帆股份 | 46,784,625.65 | 2.98 |
| 33 | 300377 | 赢时胜  | 46,512,055.54 | 2.97 |
| 34 | 002462 | 嘉事堂  | 46,246,261.91 | 2.95 |
| 35 | 600498 | 烽火通信 | 45,745,196.86 | 2.92 |
| 36 | 300034 | 钢研高纳 | 45,166,648.29 | 2.88 |
| 37 | 300150 | 世纪瑞尔 | 45,106,152.88 | 2.88 |
| 38 | 000951 | 中国重汽 | 45,015,070.32 | 2.87 |
| 39 | 600202 | 哈空调  | 44,761,668.16 | 2.85 |
| 40 | 300220 | 金运激光 | 44,068,055.40 | 2.81 |
| 41 | 603308 | 应流股份 | 43,508,030.69 | 2.77 |
| 42 | 300140 | 启源装备 | 43,296,519.57 | 2.76 |
| 43 | 300353 | 东土科技 | 43,138,426.23 | 2.75 |
| 44 | 002279 | 久其软件 | 42,930,813.94 | 2.74 |
| 45 | 300050 | 世纪鼎利 | 42,905,192.56 | 2.74 |
| 46 | 002318 | 久立特材 | 42,209,459.88 | 2.69 |
| 47 | 300325 | 德威新材 | 41,974,121.31 | 2.68 |
| 48 | 601318 | 中国平安 | 41,949,661.75 | 2.67 |
| 49 | 002051 | 中工国际 | 41,897,681.85 | 2.67 |
| 50 | 600149 | 廊坊发展 | 41,860,307.86 | 2.67 |
| 51 | 600290 | 华仪电气 | 39,664,820.05 | 2.53 |
| 52 | 002074 | 东源电器 | 39,545,898.01 | 2.52 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 53 | 002184 | 海得控制 | 39,299,504.77 | 2.51 |
| 54 | 600358 | 国旅联合 | 39,181,885.26 | 2.50 |
| 55 | 300147 | 香雪制药 | 38,873,460.90 | 2.48 |
| 56 | 600259 | 广晟有色 | 38,420,586.80 | 2.45 |
| 57 | 600369 | 西南证券 | 37,764,718.20 | 2.41 |
| 58 | 300295 | 三六五网 | 37,474,512.77 | 2.39 |
| 59 | 002373 | 千方科技 | 37,368,314.37 | 2.38 |
| 60 | 300139 | 福星晓程 | 37,341,328.43 | 2.38 |
| 61 | 002588 | 史丹利  | 37,043,739.58 | 2.36 |
| 62 | 300204 | 舒泰神  | 37,007,384.27 | 2.36 |
| 63 | 600026 | 中海发展 | 36,574,981.90 | 2.33 |
| 64 | 600869 | 智慧能源 | 36,251,801.26 | 2.31 |
| 65 | 002139 | 拓邦股份 | 35,904,217.59 | 2.29 |
| 66 | 002438 | 江苏神通 | 35,549,462.72 | 2.27 |
| 67 | 002052 | 同洲电子 | 35,324,586.23 | 2.25 |
| 68 | 002256 | 彩虹精化 | 35,256,232.94 | 2.25 |
| 69 | 300329 | 海伦钢琴 | 34,460,521.42 | 2.20 |
| 70 | 000861 | 海印股份 | 31,728,965.13 | 2.02 |
| 71 | 002244 | 滨江集团 | 31,619,530.54 | 2.02 |
| 72 | 300118 | 东方日升 | 31,584,632.07 | 2.01 |

注：表中“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

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 5,143,590,566.97 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 5,061,549,731.10 |

注：表中“买入股票成本”或“卖出股票收入”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进行贵金属投资。

**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**

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

**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**

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**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 | 854,093.41 |

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 45,834,047.98 |
| 3 | 应收股利    | —             |
| 4 | 应收利息    | 23,106.89     |
| 5 | 应收申购款   | —             |
| 6 | 其他应收款   | 110,493.05    |
| 7 | 待摊费用    | —             |
| 8 | 其他      | —             |
| 9 | 合计      | 46,821,741.33 |

#### 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可转债。

#### 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  | 002183 | 怡亚通  | 75,751,872.35 | 9.71         | 重大事项停牌   |

注：本基金截至2015年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 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<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构    |            |          |            |
|--------------|---------------|----------|------------|----------|------------|
|              |               | 机构投资者    |            | 个人投资者    |            |
|              |               | 持有<br>份额 | 占总份<br>额比例 | 持有<br>份额 | 占总份<br>额比例 |
|              |               |          |            |          |            |

|        |           |              |       |                |        |
|--------|-----------|--------------|-------|----------------|--------|
| 27,415 | 18,799.85 | 4,483,124.00 | 0.87% | 510,914,957.95 | 99.13% |
|--------|-----------|--------------|-------|----------------|--------|

### 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 | 4,351,787.01 | 0.84%    |

### 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<br>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(2014年12月30日)基金份额总额 | 1,568,594,317.69 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 1,568,594,317.69 |
| 本报告期基金总申购份额                | 802,111,264.08   |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 1,855,307,499.82 |
| 本报告期基金拆分变动份额               | —                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 515,398,081.95   |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开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

本报告期内，本基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司由原合规风控总监盛建龙先生变更为高玮女士。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同成立以来一直聘请北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

### 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

报告期内基金管理人、托管人的业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

### 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比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 浙商证券 | 2      | 10,202,251,985.82 | 100%        | 9,288,111.87 | 100%       | —  |

注：a)本报告期内本基金券商交易单元无变更。

b)本公司作为浙商证券股份有限公司的全资子公司，根据交易所一般要求，优先租用浙商证券的交易单元。本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

- c) 基金交易单元的选择程序如下：
- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
  - 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 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比例 | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额比例 |
| 浙商证券 | —    | —           | 18,740,100,000 | 100%          | —    | —           |

注：a)本报告期内本基金券商交易单元无变更。

b)本公司作为浙商证券股份有限公司的全资子公司，根据交易所一般要求，优先租用浙商证券的交易单元。本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
  - 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
  - 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
- c) 基金交易单元的选择程序如下：
- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
  - 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 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  | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金年度最后一个市场交易日净值公告          | 公司网站、上海证券报 | 2015-01-01 |
| 2  | 关于增加深圳众禄基金销售有限公司为浙商汇金转型成长混合型证券投资基金推广机构的公告 | 公司网站、上海证券报 | 2015-01-27 |
| 3  | 关于增加浙江同花顺基金销售有                            | 公司网站、上海证券报 | 2015-02-12 |

|    |   |            |            |
|----|---|------------|------------|
|    | 限公司为浙商汇金转型成长混合型证券投资基金推广机构的公告              |            |            |
| 4  | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金开放申购、赎回业务公告              | 公司网站、上海证券报 | 2015-03-03 |
| 5  | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加同花顺基金申购费率优惠活动的公告     | 公司网址、上海证券报 | 2015-03-05 |
| 6  | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加好买基金申购费率优惠活动的公告      | 公司网址、上海证券报 | 2015-03-05 |
| 7  | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加数米基金申购费率优惠活动的公告      | 公司网址、上海证券报 | 2015-03-05 |
| 8  | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加浙商证券申购费率优惠活动的公告      | 公司网址、上海证券报 | 2015-03-05 |
| 9  | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加天天基金申购费率优惠活动的公告      | 公司网址、上海证券报 | 2015-03-05 |
| 10 | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加深圳众禄申购费率优惠活动的公告      | 公司网址、上海证券报 | 2015-03-05 |
| 11 | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加中国银行申购费率优惠活动的公告      | 公司网址、上海证券报 | 2015-03-05 |
| 12 | 关于增加上海天天基金销售有限公司为浙商汇金转型成长混合型证券投资基金推广机构的公告 | 公司网站、上海证券报 | 2015-03-06 |
| 13 | 浙江浙商证券资产管理有限公司关于合规风控总监变更的公告               | 公司网站、上海证券报 | 2015-04-22 |
| 14 | 汇金转型成长混合型证券投资基金2015年第一季度报告                | 公司网站、上海证券报 | 2015-04-22 |
| 15 | 浙商汇金转型成长混合型证券投资                           | 公司网站、上海证券报 | 2015-04-30 |



|    |   |            |            |
|----|---|------------|------------|
|    | 资基金关于参加同花顺基金申购费率优惠活动的公告                           |            |            |
| 16 | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加天天基金申购费率优惠活动的公告              | 公司网站、上海证券报 | 2015-04-30 |
| 17 | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加浙商证券申购费率优惠活动的公告              | 公司网站、上海证券报 | 2015-04-30 |
| 18 | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加深圳众禄申购费率优惠活动的公告              | 公司网站、上海证券报 | 2015-04-30 |
| 19 | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加好买基金申购费率优惠活动的公告              | 公司网站、上海证券报 | 2015-04-30 |
| 20 | 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金关于参加数米基金申购费率优惠活动的公告              | 公司网站、上海证券报 | 2015-04-30 |
| 21 | 浙江浙商证券资产管理有限公司公募基金直销柜台关于调整浙商汇金转型成长混合型证券投资基金申购费的公告 | 公司网站、上海证券报 | 2015-05-22 |
| 22 | 浙江浙商证券资产管理有限公司关于公募基金开通直销柜台业务的公告                   | 公司网站、上海证券报 | 2015-05-22 |
| 23 | 关于浙商汇金转型成长混合型证券投资基金暂停申购业务的公告                      | 公司网站、上海证券报 | 2015-06-10 |
| 24 | 关于浙商汇金转型成长混合型证券投资基金2015年第一次分红公告                   | 公司网站、上海证券报 | 2015-06-12 |
| 25 | 关于浙商汇金转型成长混合型证券投资基金第一次分红的更正公告                     | 公司网站、上海证券报 | 2015-06-17 |
| 26 | 浙江浙商证券资产管理有限公司                                    | 公司网站、上海证券报 | 2015-06-30 |

|  |   |  |  |
|--|---|--|--|
|  | <p>关于旗下部门基金增加北京恒天明泽基金销售有限公司为代理销售机构的公告</p> |  |  |
|--|---|--|--|

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本期末发生影响投资者决策的其他重要信息。

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准设立浙商汇金转型成长混合型证券投资基金的文件；

《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金基金合同》；

《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金托管协议》；

报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

基金管理人业务资格批件、营业执照。

#### 12.2 存放地点

浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场C座11楼浙江浙商证券资产管理有限公司

#### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查询；亦可通过公司网站查阅，公司网址为：  
www.stocke.com.cn。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二〇一五年八月二十六日

