

**浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告摘要**

**2015年12月31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：2016年3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2016年3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。北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者仔细阅读。

本报告期自2015年7月27日(基金合同生效日)起至12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	浙商汇金转型驱动
基金主代码	001540
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月27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	1,071,233,408.91
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	<p>本基金通过定性分析和定量分析互补的研究手段，深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标和政策因素等，动态调整基金资产中股票和债券等类别资产的比例，有效的控制不同市场形势下的风险和收益水平。</p> <p>本基金主要投资于在中国经济结构转型的时代背景下，能够主动通过选择新的经济驱动模式，适应经济增速阶段性回落的新常态，展现自身优势并取得显著业绩增长的行业和上市公司。</p>
业绩比较基准	中证500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
	联系电话	0571-87901907
	电子邮箱	gaowei@stocke.com.cn
客户服务电话	95345	95566
传真	0571-87902581	010-66594942

## 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	www.stocke.com.cn
基金年度报告备置地点	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

## § 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年7月27日-2015年12月31日
本期已实现收益	-70,600,583.47
本期利润	-23,070,030.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0171
本期加权平均净值利润率	-1.78%
本期基金份额净值增长率	-1.80%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配利润	-41,512,850.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0388
期末基金资产净值	1,052,006,829.73
期末基金份额净值	0.982
3.1.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	-1.80%

注：1、本基金合同于2015年7月27日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

- 2、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。
- 3、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。
- 4、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。

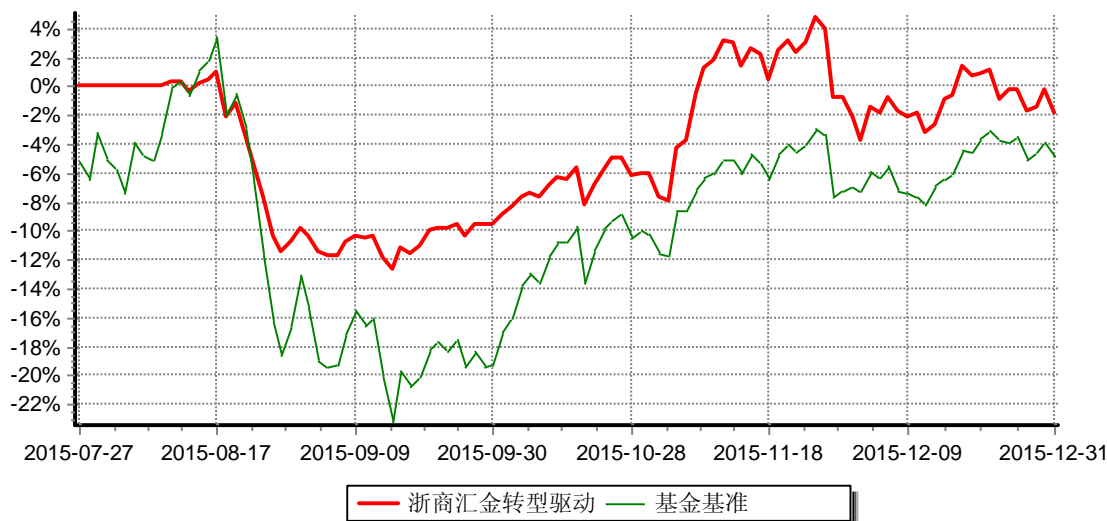
### 3.2 基金净值表现

#### 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	8.63%	1.44%	17.66%	1.43%	-9.03%	0.01%
自基金合同生效日起至今（2015年07月27日-2015年12月31日）	-1.80%	1.30%	-4.97%	2.10%	3.17%	-0.80%

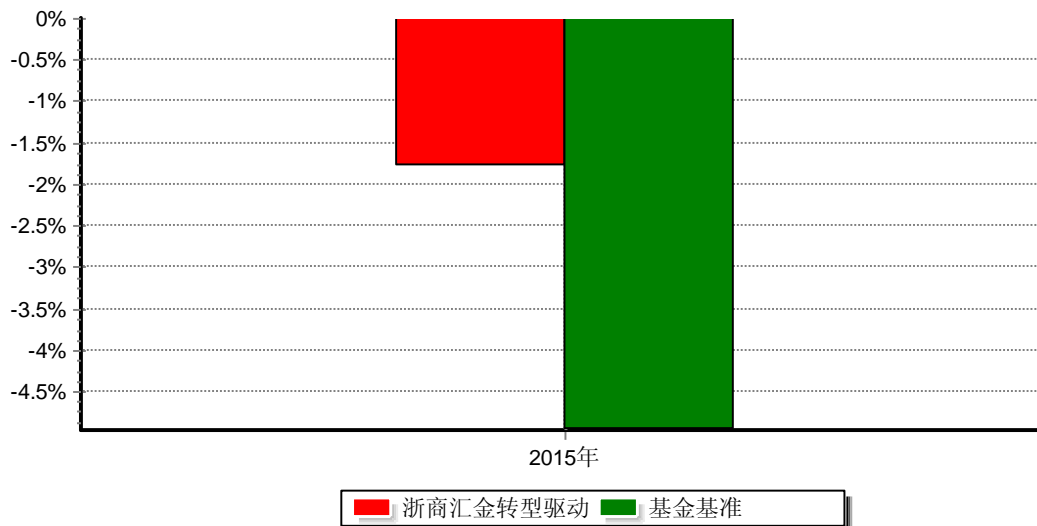
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2015年7月27日-2015年12月31日）



注：本基金合同生效日为2015年7月27日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。至报告期末，本基金建仓期尚未结束。

### 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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2015年7月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日未进行利润分配。

## § 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

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12月31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和浙商汇金转型驱动灵活配置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（助	证券从	说明
----	----	-------------	-----	----

		理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
李冬	本基金基金经理、浙商汇金转型成长基金基金经理、公司公募基金公司行政负责人。	2015年7月27日	—	8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基金及浙商汇金转型驱动基金基金经理、公司公募基金公司行政负责人。
唐光英	本基金基金经理	2015年8月28日	—	9年	硕士，先后在上海证券有限责任公司、诺德基金管理有限公司、浙江浙商证券资产管理有限公司从事研究、投资工作，曾任浙商汇金新经济第二季投资主办，现任浙商汇金转型驱动基金基金经理。

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驱动灵活配置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》、《浙商汇金转型驱动灵活配置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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定制定了公司《公平交易管理办法》。公司公平交易体系涵盖研究分析、投资决策、交易执行、交易监控等投资管理活动相关的各个环节，各环节公平措施简要如下：

公司各投资组合共用研究平台、共享信息，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司接受的外部研究报告、内部研究人员撰写的研究报告对公司各投资组合经理开放。

投资组合经理在授权权限范围内做出投资决策，并负责投资决策的具体实施。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。同时，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度。并在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，交易系统将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。

公司合规风控部定期对不同投资组合交易情况进行分析，对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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年是A股市场不寻常的一年，上半年在杠杆的驱动下走出波澜壮阔的大牛市，下半年在去杠杆和汇率贬值的因素下两波大幅调整。本基金成立于2015年7月27日，适逢市场大幅调整期，在经历8月的大幅波动后，9月筑底企稳，10月、11月在创业板的带领下强劲反弹，但12月又回到弱势震荡整理，总体来看，基金成立以来市场波动较大，未出现大的趋势性行情，由于成立时间较短，本基金一直保持较低的仓位进行运作，重点布局了新能源汽车、医疗服务、传媒、计算机、智能制造等领域。



#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年12月31日，本基金份额净值为0.982元。报告期内，本基金的净值增长率为-1.8%，业绩比较基准收益率为-4.97%，跑赢业绩基准。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济增速换挡，结构分化，这已成为新常态，2016年宏观经济将持续放缓，政策提供关键缓冲。A股市场在经历两年大牛市后，2016年将是个小年，总体难度加大，超额收益将来自跌出来的机会，对投资者来说，需更加精益求精，挖掘景气细分领域中的优质成长股显得更加重要。行业趋势上，我们仍然看好代表新经济的方向，虽然新事物的发展不是一帆风顺的，但我们相信，符合国家政策、符合经济发展规律的新产业终将成为经济的支柱力量。

#### 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

根据《浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定，本基金在本报告期内未达到基金分配的标准，未进行利润分配。

### § 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”）在浙商汇金转型驱动灵

活配置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合规守信、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	[2016]京会兴审字第14020135号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“浙商汇金转型驱动”)的财务报表，包括2015年12月 31 日的资产负债表、2015年 7 月 27 日(基金合同生效日)至2015年 12月 31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是浙商汇金转型驱动的基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司管理

	<p>层的责任。这种责任包括：(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
<p>注册会计师的责任段</p>	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>审计意见段</p>	<p>我们认为，上述浙商汇金转型驱动的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了浙商汇金转型驱动2015年12月31日的财务状况以及2015年7月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>张庆栾、李 鑫</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>浙江浙商证券资产管理有限公司</p>

审计报告日期	2016-02-18
--------	------------

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款		346,100,180.75
结算备付金		44,430,005.98
存出保证金		809,543.46
交易性金融资产		749,362,963.38
其中：股票投资		749,362,963.38
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		—
买入返售金融资产		—
应收证券清算款		—
应收利息		70,492.73
应收股利		—
应收申购款		71,570.58
递延所得税资产		—
其他资产		—
资产总计		1,140,844,756.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015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		—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		83,973,781.29
应付赎回款		1,914,190.16
应付管理人报酬		1,390,705.40
应付托管费		231,784.21
应付销售服务费		—
应付交易费用		1,272,782.54
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债		54,683.55
负债合计		88,837,927.15
<b>所有者权益:</b>		
实收基金		1,071,233,408.91
未分配利润		-19,226,579.18
所有者权益合计		1,052,006,829.73
负债和所有者权益总计		1,140,844,756.88

注：(1) 本基金于2015年7月27日成立，无上年度可比期间数据。

(2) 报告截止日2015年12月31日，基金份额净值0.982元，份额总额1,071,233,408.91份。

## 7.2 利润表

会计主体：浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年7月27日-2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年7月27日-2015年12月31日

一、收入		-5,929,805.77
1.利息收入		5,212,838.70
其中：存款利息收入		1,028,538.91
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		4,184,299.79
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		-59,905,273.00
其中：股票投资收益		-60,178,469.17
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		1,600.00
股利收益		271,596.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		47,530,553.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,232,075.17
<b>减：二、费用</b>		<b>17,140,224.34</b>
1. 管理人报酬		8,351,104.45
2. 托管费		1,391,850.71
3. 销售服务费		—
4. 交易费用		7,221,896.51
5. 利息支出		—

其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用		175,372.67
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-23,070,030.11
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-23,070,030.11

注：(1)本基金于2015年7月27日成立，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年7月27日-2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年7月27日-2015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)	1,481,882,806.40	—	1,481,882,806.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-23,070,030.11	-23,070,030.11
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)	-410,649,397.49	3,843,450.93	-406,805,946.56
其中：1.基金申购款	38,605,656.10	-433,117.67	38,172,538.43
2.基金赎回款	-449,255,053.59	4,276,568.60	-444,978,484.99
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)	1,071,233,408.91	-19,226,579.18	1,052,006,829.73

注：(1)本基金于2015年7月27日成立，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

李雪峰

盛建龙

冯建兰

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

浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"或"本基金")经中国证监会证监许可[2015]1244号《关于准予浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》确认,由浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称"浙商资产管理公司")作为管理人,中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")作为托管人,于2015年7月27日募集设立。浙商证券股份有限公司(以下简称"浙商股份")、中国银行、中国光大银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、上海汇付金融服务有限公司是本基金的推广机构。本基金的募集期间为2015年7月1日至2015年7月17日止,本基金类型为混合型证券投资基金,基金的运作方式为契约型开放式,存续期为不定期。

根据《浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金说明书》约定,本基金的推广对象为:符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。每份基金资产面值为人民币1.00元。截至2015年7月21日止,本基金已收到有效认购资金金额人民币1,481,775,663.65元,折合份额为1,481,775,663.65份,募集期间产生的利息折合份额为107,142.75份,共计1,481,882,806.40份。设立募集资金已经北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)杭州分公司验资,并出具[2015]京会兴浙分验字第68000083号验资报告。

截至2015年12月31日,本基金有效份额为1,071,233,408.91份。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定而编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准



则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的要求，真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年7月27日（基金合同生效日）至2015年12月31日的经营成果和基金资产净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制，即自每年1月1日至12月31日为一个会计年度。本报告会计期间为2015年7月27日（基金合同生效日）至2015年12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（包括交易性金融资产和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产）、贷款和应收款项。

金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债）、其他金融负债。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1)贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2)在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将

来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2)与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3)不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1)按照《企业会计准则第13号--或有事项》确定的金额；2)初始确认金额扣除按照《企业会计准则第14号--收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

##### 1. 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

##### 2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一

股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4. 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5. 股指期货合约按照估值日的结算价估值；当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的结算价估值。

6. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7. 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

每份计划份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的计划份额总额。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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、基金投资收益于卖出股票、基金成交日确认，并按卖出股票、基金成交金额与其成本的差额入账，同时调整公允价值变动损益；

5. 债券投资收益于成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额入账，同时调整公允价值变动损益；

6. 衍生工具投资收益于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账，同时调整公允价值变动损益；

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应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

8. 公允价值变动损益系本基金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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

##### 1. 管理人的管理费

本基金应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费；

E 为前一日基金资产净值。

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。

##### 2. 托管人的托管费：

本基金应给付托管人托管费，按前一日的资产净值的0.25%的年费率计提。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。

### 3. 基金的证券交易费用

基金资产运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，在收取时从基金资产中直接扣除，交易佣金的费率由管理人本着保护委托人利益的原则，按照法律法规的规定确定，本基金不设置最小佣金限制。

### 4. 按照国家有关规定可以列入的其他费用

本基金存续期间发生的信息披露费，与基金资产相关的会计师审计费和律师费、基金资产终止时的清算费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据其他相关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金资产费用。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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。

## 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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号--公允价值计量》、《企业会计准则第40号--合营安排》、《企业会计准则第41号--在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号--长期股权投资》、《企业会计准则第9号--职工薪酬》、《企业会计准则第30号--财务报表列报》、《企业会计准则第33号--合并财务报表》以及《企业会计准则第37号--金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号--金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

## 7.4.6 税项

### (一) 印花税

本基金管理人运用本基金买卖，股票按照1%的税率单边缴纳印花税。

### (二) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

## 7.4.7 关联方关系

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("浙商资管")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金销售机构
浙商证券股份有限公司("浙商证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

注：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。以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年7月27日-2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
浙商证券	4,699,636,129.18	93.23%

注：本基金合同生效日为2015年7月27日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年7月27日-2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
浙商证券	58,084,900,000.00	100.00%

注：本基金合同生效日为2015年7月27日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年7月27日-2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

浙商证券	4,376,764.78	94.61%	1,272,782.54	100.00%
------	--------------	--------	--------------	---------

注：本基金合同生效日为2015年7月27日，无上年度同期对比数据。

上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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
	2015年7月27日-2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,351,104.45
其中：支付销售机构的客户维护费	—

注：本基金合同生效日为 2015 年7月 27日，无上年度同期对比数据。

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。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年7月27日-2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,391,850.71

注：本基金合同生效日为2015年7月27日，无上年度同期对比数据。

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。

#### 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

本基金本报告期内未通过银行间同业市场与关联方进行债券（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自有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

项目	本期 2015年7月27日-2015年12月31日
基金合同生效日（2015年7月27日）持有的基金份额	9,999,000.00
期初持有的基金份额	—
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	—
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	—
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	—
期末持有的基金份额	9,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.93%

注：本基金管理人运用自有资金投资本基金费率与其他投资者执行的费率一致。

##### 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

注：本基金其它关联方在本报告期内未投资本基金。

#### 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 2015年7月27日-2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	346,100,180.75	623,050.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。本基金合同生效日为2015年7月27日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 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。

### 7.4.9 期末（2015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

注：截止本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 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 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
002006	精功科技	2015-12-11	重大事项	14.70		—	1,483,902	21,020,447.25	21,813,359.40
002707	众信旅游	2015-11-16	重大事项	52.62		—	65,090	1,978,836.95	3,425,035.80
300049	福瑞股份	2015-11-30	重大事项	31.00	2016-01-04	30.95	431,400	13,379,610.33	13,373,400.00

#### 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

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金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为0,无抵押债券。

### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

## § 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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	749,362,963.38	65.68
	其中：股票	749,362,963.38	65.68
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	390,530,186.73	34.23
7	其他各项资产	951,606.77	0.08
8	合计	1,140,844,756.88	100.00

### 8.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	501,439,862.43	47.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—

F	批发和零售业	21,264,550.84	2.02
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	152,305,062.77	14.48
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	50,745,485.84	4.82
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	23,608,001.50	2.24
S	综合	—	—
	合计	749,362,963.38	71.23

### 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

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	占基金资产净值比例(%)
1	002006	精功科技	4,541,405	66,758,653.50	6.35
2	002196	方正电机	1,464,773	44,939,235.64	4.27
3	300109	新开源	373,750	38,888,687.50	3.70
4	600358	国旅联合	2,250,571	38,259,707.00	3.64
5	002395	双象股份	1,180,615	35,890,696.00	3.41
6	002657	中科金财	445,650	35,647,543.50	3.39
7	300352	北信源	559,920	34,939,008.00	3.32
8	300160	秀强股份	867,691	34,751,024.55	3.30
9	600172	黄河旋风	1,317,710	33,351,240.10	3.17
10	300243	瑞丰高材	1,535,689	31,174,486.70	2.96

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网址

[www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)上的年度报告全文。

## 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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002196	方正电机	83,590,090.53	7.95
2	600358	国旅联合	74,009,420.76	7.04
3	002006	精工科技	65,306,280.30	6.21
4	600138	中青旅	55,926,981.63	5.32
5	600109	国金证券	53,385,306.08	5.07
6	000728	国元证券	53,232,889.24	5.06
7	600172	黄河旋风	53,201,340.31	5.06
8	600958	东方证券	53,056,592.92	5.04
9	002325	洪涛股份	49,447,826.90	4.70
10	600547	山东黄金	44,938,383.90	4.27
11	002462	嘉事堂	42,344,691.98	4.03
12	300352	北信源	41,552,303.80	3.95
13	600826	兰生股份	39,870,070.78	3.79
14	002657	中科金财	37,911,793.12	3.60
15	002395	双象股份	37,159,251.15	3.53
16	002279	久其软件	36,755,703.46	3.49
17	300047	天源迪科	35,878,749.44	3.41
18	600687	刚泰控股	35,791,784.30	3.40
19	300012	华测检测	35,550,879.38	3.38
20	600895	张江高科	34,115,426.64	3.24
21	300161	华中数控	33,123,975.58	3.15
22	300160	秀强股份	32,704,837.30	3.11
23	600596	新安股份	32,672,728.15	3.11
24	300244	迪安诊断	32,557,132.56	3.09

25	002467	二六三	31,921,411.96	3.03
26	002601	佰利联	31,690,703.82	3.01
27	300243	瑞丰高材	31,644,520.63	3.01
28	002121	科陆电子	29,717,683.24	2.82
29	002678	珠江钢琴	29,667,167.13	2.82
30	300201	海伦哲	29,508,882.54	2.81
31	300379	东方通	28,696,084.40	2.73
32	002155	湖南黄金	28,390,725.92	2.70
33	002098	浔兴股份	28,239,895.48	2.68
34	300049	福瑞股份	28,194,628.91	2.68
35	300250	初灵信息	27,480,354.22	2.61
36	000712	锦龙股份	26,441,430.18	2.51
37	300016	北陆药业	26,156,079.20	2.49
38	601166	兴业银行	26,107,685.09	2.48
39	002170	芭田股份	25,896,573.43	2.46
40	603939	益丰药房	25,765,115.58	2.45
41	300021	大禹节水	25,735,924.50	2.45
42	002253	川大智胜	25,392,819.70	2.41
43	002169	智光电气	25,102,836.00	2.39
44	300017	网宿科技	24,152,350.31	2.30
45	300073	当升科技	22,288,636.42	2.12
46	300048	合康变频	22,288,390.00	2.12
47	000793	华闻传媒	22,142,985.21	2.10
48	000401	冀东水泥	22,062,034.66	2.10
49	000545	金浦钛业	22,056,697.86	2.10
50	002019	亿帆鑫富	21,979,942.58	2.09
51	300232	洲明科技	21,802,085.10	2.07
52	002244	滨江集团	21,751,649.84	2.07
53	300291	华录百纳	21,595,640.45	2.05
54	600158	中体产业	21,572,194.97	2.05

55	002123	荣信股份	21,396,688.00	2.03
56	600728	佳都科技	21,395,207.00	2.03
57	002009	天奇股份	21,367,456.79	2.03
58	002137	麦达数字	21,287,596.00	2.02
59	002171	楚江新材	21,213,416.06	2.02

注：买卖成交金额按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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600958	东方证券	66,480,520.49	6.32
2	600109	国金证券	56,964,586.46	5.41
3	600138	中青旅	56,584,194.77	5.38
4	000728	国元证券	56,271,246.53	5.35
5	002325	洪涛股份	47,036,905.04	4.47
6	300047	天源迪科	40,675,699.51	3.87
7	002196	方正电机	40,279,544.73	3.83
8	600358	国旅联合	39,137,721.49	3.72
9	600826	兰生股份	38,618,744.64	3.67
10	300017	网宿科技	35,955,839.79	3.42
11	600547	山东黄金	34,919,173.58	3.32
12	300016	北陆药业	30,863,555.54	2.93
13	300012	华测检测	30,852,476.70	2.93
14	300244	迪安诊断	30,165,421.97	2.87
15	600596	新安股份	30,155,471.27	2.87
16	600895	张江高科	29,807,715.61	2.83
17	603939	益丰药房	29,699,844.55	2.82
18	601166	兴业银行	28,969,569.60	2.75
19	002601	佰利联	28,677,506.38	2.73
20	002170	芭田股份	28,630,691.95	2.72

21	600687	刚泰控股	28,340,620.45	2.69
22	600172	黄河旋风	28,236,466.47	2.68
23	300201	海伦哲	27,911,513.66	2.65
24	000712	锦龙股份	27,619,937.70	2.63
25	002121	科陆电子	27,337,228.75	2.60
26	300379	东方通	26,702,047.88	2.54
27	002678	珠江钢琴	26,168,536.07	2.49
28	002462	嘉事堂	25,648,393.57	2.44
29	002253	川大智胜	25,087,696.60	2.38
30	300048	合康变频	24,735,382.31	2.35
31	002169	智光电气	24,631,724.13	2.34
32	002098	浔兴股份	24,466,868.82	2.33
33	300021	大禹节水	24,294,770.14	2.31
34	601801	皖新传媒	23,742,741.76	2.26
35	002244	滨江集团	23,010,497.00	2.19
36	300073	当升科技	22,497,741.62	2.14
37	000401	冀东水泥	22,461,745.70	2.14
38	600416	湘电股份	22,311,095.40	2.12
39	300050	世纪鼎利	21,906,410.82	2.08
40	000545	金浦钛业	21,799,171.80	2.07
41	000788	北大医药	21,415,038.77	2.04
42	600054	黄山旅游	21,356,633.73	2.03
43	002019	亿帆鑫富	21,080,029.80	2.00

注：买卖成交金额按成交单价乘以成交数量填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,903,344,147.67
卖出股票的收入（成交）总额	2,141,333,268.48

### 8.5 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。

#### **8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

#### **8.8 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**

本基金本报告期末进行贵金属投资。

#### **8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

#### **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **8.10.1 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,但在本报告期间投资IC1511股指期货品种,投资收益为1600元。

##### **8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金在报告期内投资IC1511期货品种,基于套期保值的需求,本基金适当参与股指期货的投资,以对当前投资组合的避险保值为目标,控制下行风险,平滑基金资产净值的波动。本基金参与股指期货投资,符合既定的投资政策和投资目标。

#### **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **8.11.1 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。

##### **8.11.2 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。

#### **8.12 投资组合报告附注**

8.12.1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。

8.12.2本基金投资的前十名股票中,未超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	809,543.46
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	70,492.73
5	应收申购款	71,570.58
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	951,606.77

### 8.12.4 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处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 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	002006	精功科技	66,758,653.50	6.35	重大资产重组事项

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
9,087	117,886.37	21,335,960.08	1.99%	1,049,897,448.8 3	98.01%

## 9.2 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	1,585,300.03	0.15%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年7月27日)基金份额总额	1,481,882,806.40
本报告期期初基金份额总额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	38,605,656.10
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	449,255,053.59
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,071,233,408.91

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

基金管理人的重大人事变动：2015年4月，合规风控总监由盛建龙先生变更为高玮女士。2015年8月，增聘唐光英为浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，与李冬先生共同管理该基金。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 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,本报告年度的审计费用为50,000元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内，本基金管理人和托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	1	139,273,105.67	2.76%	101,850.09	2.20%	
海通证券	1	201,923,221.40	4.00%	147,665.25	3.19%	
浙商证券	2	4,703,467,329.08	93.24%	4,380,332.80	94.61%	

注：a)本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格，上海证券市场只能使用母公司浙商证券席位进行交易。截至报告期末，本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。本报告期内本基金券商交易单元新增了浙商证券、国海证券和海通证券。就本报告期内管理人通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金超过当年所有基金买卖证券交易佣金30%的情况，管理人已向监管机构报告，并等待进一步指示与解决。

b)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、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；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。

### 11.7.2 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	占债券 成交总额比例	成交金额	占债券回购 成交总额比例	成交金额	占权证 成交总额比例
国海证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	58,084,900 ,000.00	100.00%	—	—

浙江浙商证券资产管理有限公司  
二〇一六年三月二十六日