

# 浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
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.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
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
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 投资组合报告附注.....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>53</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
8.4 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的情况 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
11.1 备查文件目录 .....	58
11.2 存放地点 .....	58
11.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	浙商沪深 300 指数分级		
场内简称	浙商 300		
基金主代码	166802		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 5 月 7 日		
基金管理人	浙商基金管理有限公司		
基金托管人	华夏银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	49,755,329.88 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 7 月 13 日		
下属分级基金的基金简称	浙商稳健	浙商进取	浙商沪深 300 指数分级
下属分级基金的交易代码	150076	150077	166802
报告期末下属分级基金份额总额	3,048,711.00 份	3,048,712.00 份	43,657,906.88 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。
投资策略	<p>本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以股指期货等金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，浙商稳健份额具

	有低风险、收益相对稳定的特征；浙商进取份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	本浙商稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	浙商进取份额具有高风险、高预期收益的特征。	基金为跟踪指数的股票型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 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		浙商基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	徐昊光
	联系电话	021-60350812	010-85238982
	电子邮箱	guoleqi@zsfund.com	bjxhg@hxb.com.cn
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	95577
传真		0571-28191919	010-85238680
注册地址		浙江省杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址		浙江省杭州市西湖区教工路 18 号世贸丽晶欧美中心 B 座 507 室	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码		310012	100005
法定代表人		肖风	吴建

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.zsfund.com">http://www.zsfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海南京西路 1266 号恒隆广场 50 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-2,266,135.03
本期利润	-9,141,331.85
加权平均基金份额本期利润	-0.1784
本期加权平均净值利润率	-16.89%
本期基金份额净值增长率	-15.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	8,180,974.22
期末可供分配基金份额利润	0.1644
期末基金资产净值	52,991,036.07
期末基金份额净值	1.065
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	18.10%

注：上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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 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
过去一个月	-0.09%	0.91%	-0.46%	0.93%	0.37%	-0.02%
过去三个月	-1.66%	0.97%	-1.87%	0.96%	0.21%	0.01%
过去六个月	-15.36%	1.80%	-14.65%	1.75%	-0.71%	0.05%
过去一年	-29.22%	2.22%	-27.99%	2.19%	-1.23%	0.03%
过去三年	38.52%	1.75%	41.77%	1.75%	-3.25%	0.00%
自基金合同生效起至今	18.10%	1.62%	16.27%	1.63%	1.83%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 95\% + \text{金融同业存款利率} \times 5\%$ 。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2012 年 5 月 7 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间已满一年。

2、本基金建仓期为 6 个月，从 2012 年 5 月 7 日至 2012 年 11 月 6 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。



## § 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

浙商基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会(证监许可[2010]1312 号)批准,于 2010 年 10 月 21 日成立。公司股东为浙商证券股份有限公司、通联资本管理有限公司、养生堂有限公司、浙大网新集团有限公司,四家股东各出资 7500 万元,公司注册资本 3 亿元人民币。注册地为浙江省杭州市。

截至 2016 年 6 月 30 日,浙商基金共管理九只开放式基金——浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合证券投资基金、浙商沪深 300 指数分级证券投资基金、浙商聚盈信用债债券型证券投资基金、浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金、浙商日添利货币市场基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金、浙商惠享纯债债券型证券投资基金。

#### 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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
查晓磊	本基金的基金经理,公司衍生品及量化投资部副总经理	2015 年 8 月 11 日	-	5	查晓磊先生,香港中文大学财务学博士。历任博时基金管理有限公司投资策略及大宗商品分析师。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

为了规范公平交易行为,保护投资者合法权益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规规定,本公司制定了相应的公平交易制度。在投资决策层面,本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,对不同类别的投资组合分别管理、独立决策;在交易层面,实行集中交易制度,建立了公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,严禁在不同投资组合之间进行利益输送;在监控和评估层面,本公司金融工程小组将每日审查当天的投资交易,对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控,同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内,本基金未发生违反公平交易制度的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

### 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

本基金通过投资约束和数量化控制,按照基金合同的要求,使用定量分析等技术,分析和应对导致基金跟踪误差的因素,积极应对市场的剧烈变化,努力将基金的跟踪误差控制在较低水平,实现基金约定的投资策略,达到相应的投资目的。报告期内,本基金较好的控制了跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 1.065 元,报告期内净值增长率为-15.36%,业绩比较基准收益率为-14.65%,基金净值增长率低于业绩比较基准 0.71%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济维持在有限区间内波动,外部环境不确定性增加,制度层面的建设仍有进一步提升空间。

资本市场将继续以结构性特征为主，同时，在某些阶段，需要防范系统性风险发生的可能。在利率下行的过程中，以蓝筹和分红率为代表公司，将更可能获得相对收益能力。

作为指数分级基金，本基金将继续深入研究更加高效的交易策略、风险控制方法，积极应对大额、频繁申购赎回及其他突发事件带来的冲击。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，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，会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作的估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。公司估值委员会成员中不包括基金经理。报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同约定，本基金不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

## § 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，

能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，浙商沪深 300 指数分级证券投资基金未进行利润分配。

### 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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2016 年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：浙商沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,753,828.71	2,921,128.17
结算备付金		-	9,842.20
存出保证金		13,284.06	83,810.46
交易性金融资产	6.4.7.2	49,564,139.24	57,949,168.19
其中：股票投资		49,564,139.24	57,949,168.19
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	-	-
应收证券清算款		-	468,217.35
应收利息	6.4.7.5	714.99	1,336.74
应收股利		-	-
应收申购款		429.48	39,779.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		53,332,396.48	61,473,282.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		25.27	-
应付赎回款		25,661.09	37,425.69
应付管理人报酬		43,412.85	52,444.59
应付托管费		9,550.81	11,537.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,947.81	44,257.01
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	247,762.58	285,740.98
负债合计		341,360.41	431,406.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	44,810,061.85	43,768,037.15
未分配利润	6.4.7.10	8,180,974.22	17,273,839.22
所有者权益合计		52,991,036.07	61,041,876.37
负债和所有者权益总计		53,332,396.48	61,473,282.45

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.065 元，基金份额总额 49,755,329.88 份。

本基金浙商稳健份额净值为 1.022 元，份额总额 3,048,711.00 份；浙商进取份额净值为 1.108 元，份额总额 3,048,712.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-8,559,304.41	14,544,042.97
1. 利息收入		13,874.96	19,725.16
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,874.96	19,725.16
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,709,996.37	28,884,449.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,186,202.73	28,475,329.79

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	476,206.36	409,119.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,875,196.82	-14,435,246.30
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	12,013.82	75,114.93
<b>减：二、费用</b>		582,027.44	889,402.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	269,984.74	332,619.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	59,396.66	73,176.28
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	55,580.08	233,990.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	197,065.96	249,617.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-9,141,331.85	13,654,640.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-9,141,331.85	13,654,640.08

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	43,768,037.15	17,273,839.22	61,041,876.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,141,331.85	-9,141,331.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,042,024.70	48,466.85	1,090,491.55

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	9,863,885.46	1,488,981.58	11,352,867.04
2. 基金赎回款	-8,821,860.76	-1,440,514.73	-10,262,375.49
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）	44,810,061.85	8,180,974.22	52,991,036.07
项目	上年度可比期间 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）	65,050,889.29	21,790,624.27	86,841,513.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,654,640.08	13,654,640.08
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）	-30,396,564.16	-12,314,901.24	-42,711,465.40
其中：1. 基金申购款	22,508,681.70	19,385,719.66	41,894,401.36
2. 基金赎回款	-52,905,245.86	-31,700,620.90	-84,605,866.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	34,654,325.13	23,130,363.11	57,784,688.24

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：

<u>          李志惠          </u>	<u>          唐生林          </u>	<u>          唐生林          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

浙商沪深 300 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准浙商沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可

[2012]91 号文)批准,由浙商基金管理有限公司(以下称“浙商基金公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 28 日至 2012 年 4 月 27 日公开发售,募集资金总额人民币 354,249,853.79 元,其中扣除认购费后的有效认购资金人民币 354,249,853.79 元,有效认购资金在募集期间产生利息人民币 113,748.38 元,共折合 354,363,602.17 份基金份额。上述募集资金已经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了 KPMG-B(2012) CR No.0034 号验资报告。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,基金合同已于 2012 年 5 月 7 日生效。本基金的基金管理人为浙商基金公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司(以下称“华夏银行”)。

本基金将基金份额持有人在场内初始有效认购的基金份额按照 1:1 的比例自动分离成预期收益与风险不同的两个份额类别,即为浙商稳健份额和浙商进取份额。根据浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额比例,浙商稳健份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%,浙商进取份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%,且两类基金份额的基金资产合并运作。本基金合同生效后,浙商沪深 300 份额设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。浙商稳健份额与浙商进取份额交易代码不同,只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]第 215 号文审核同意,浙商稳健 9,136,705.00 份基金份额和浙商进取 9,136,706.00 份基金额于 2012 年 7 月 13 日开始在深交所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板股票、创业板股票以及中国证监会允许基金投资的其他股票)、债券、货币市场工具、股指期货、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。



本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+金融同业存款利率 $\times$ 5%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制半年度财务报表。

#### 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

#### 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策与最近一期年度会计报表所采用的会计政策一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

人民币

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为：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。本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)均划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为应收款项，本基金目前暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。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。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为：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。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

### 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

(a) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(i) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(ii) 债券投资

买入交易所或银行间的债券均于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于获配日按支付的全部价款确认为债券投资，于权证实际取得日按附注 6.4.4.4(a)(iii)所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发

生的相关交易费用直接计入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### (b) 应收款项

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。

应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本，终止确认或摊销时收入计入当期损益。

#### (c) 其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

其他金融负债按公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本，终止确认或摊销时支出计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，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，采用最近交易市价确定公允价值，如估值日无市价，且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了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，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，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应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，确定投资品种的公允价值。

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。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。

本基金的金融资产和金融负债以上述原则确定的公允价值进行估值，另外对金融资产的特殊情况处理如下：

(a) 股票投资

(i) 对因特殊事项长期停牌的股票，如该停牌股票对基金资产净值产生重大影响，则采用《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》提供的指数收益法估值。即在估值日，以公开发布的相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率计算该股票当日的公允价值。

(ii) 送股、转增股、配股和公开增发新股，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。

(iii) 首次公开发行未上市的公司股票，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。

(iv) 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种股票的收盘价估值。

(v) 非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一种股票的收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所上市的同一种股票的收盘价估值；若在证券交易所上市的同一种股票的收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，其两者之间的差价按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例确认为估值增值。

(b) 债券投资

(i) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

(ii) 对交易所发行未上市的公司债、企业债、公司债，按成本估值；对在交易所发行未上市的可转换债券，自债券确认日至上市期间的每个估值日，按证券业协会下证券投资基金估值工作小组公布的参考价格估值。

(iii) 全国银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。对全国银行间债券市场未上市，且中央国债登记结算公司未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(iv) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易，按债券所处市场分别估值。

(c) 权证投资

(i) 首次公开发行未上市的权证，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。

(ii) 配售及认购分离交易可转债所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

(iii) 因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

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。

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。

实际成本与估值的差异计入“公允价值变动收益/(损失)”科目。

#### 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。金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金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；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益

平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于年末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于卖出交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于卖出交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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于除权除息日确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%的年费率逐日计提；

基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率逐日计提；

基金合同生效后的标的指数许可使用费即标的指数许可使用基点费，标的指数许可使用基点费的计费时间从本基金合同生效日开始计算；标的指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的 0.02%/年，基金合同生效当年，不足 3 个月的，按照 3 个月收费。标的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取）。

在通常情况下，标的指数许可使用基点费按照前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率与收取下限的日均摊销数额两者孰高的原则进行计提。标的指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：收取下限的日均摊销数额=5 万/季度\*4 季度/年÷当年天数（365 天或 366 天）  
≈550 元/天

$$H = \text{Max} (E \times 0.02\% / \text{当年天数}, 550)$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用基点费。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金（包括浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额、浙商进取份额）不进行收益分配。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于特殊事项停牌股票，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》，本基金采用《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》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用的

行业指数为中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在报告期内未发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在报告期内未发生过重大会计差错。

## 6.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- 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、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的债券的利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。
- 4、自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得实施差别化个人所得税政策：个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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。
- 5、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、对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	3,753,828.71
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,753,828.71

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	54,723,929.81	49,564,139.24	-5,159,790.57
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	54,723,929.81	49,564,139.24	-5,159,790.57

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	709.59
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	-
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	5.40
合计	714.99

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	14,947.81
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,947.81

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	96.62
审计费	27,349.14
预提费用	69,616.82
指数使用费	150,700.00
合计	247,762.58

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,424,278.28	43,768,037.15
本期申购	12,125,817.04	9,863,885.46
本期赎回(以“-”号填列)	-9,794,765.44	-8,821,860.76
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	49,755,329.88	44,810,061.85

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金合同于 2012 年 5 月 7 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 354249853.79 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 113748.38 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 354363602.17 元，折合 354363602.17 份基金份额。

3、根据《基金合同》规定，浙商沪深 300 份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。浙商稳健份额与浙商进取份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

投资者可在场内申购和赎回浙商沪深 300 份额，投资者可选择将其场内申购的浙商沪深 300 份额按 1:1 的比例分拆成浙商稳健份额和浙商进取份额。投资者可按 1:1 的配比将其持有的浙商稳健份额和浙商进取份额申请合并为场内的浙商沪深 300 份额后赎回。投资者可在场外申购和赎回浙商沪深 300 份额。场外申购的浙商沪深 300 份额不进行分拆，但基金合同另有规定的除外。投资者可将其持有的场外浙商沪深 300 份额跨系统转登记至场内并申请将其分拆成浙商稳健份额和浙商进取份额后上市交易。

浙商稳健和浙商进取的本期申购是指由浙商沪深 300 指数分级的“分拆”行为带来的该类基金份额的增加，本期赎回是指因浙商稳健和浙商进取的“合并”行为导致的该类基金份额的减少。浙商沪深 300 指数分级的本期申购份额包含浙商稳健和浙商进取的份额合并的份额 6,608,234.00 以及浙商稳健份额、浙商沪深 300 份额报告期内的定期份额折算所增加的份额 1,174,123.43；本期赎回份额包含浙商稳健和浙商进取的份额拆出的份额 7,205,544.00。

#### 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	24,126,593.64	-6,852,754.42	17,273,839.22
本期利润	-2,266,135.03	-6,875,196.82	-9,141,331.85
本期基金份额交易产生的变动数	657,765.84	-609,298.99	48,466.85
其中：基金申购款	5,354,751.77	-3,865,770.19	1,488,981.58
基金赎回款	-4,696,985.93	3,256,471.20	-1,440,514.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,518,224.45	-14,337,250.23	8,180,974.22

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,318.12
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	247.23
其他	309.61
合计	13,874.96

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	17,804,240.57
减：卖出股票成本总额	19,990,443.30
买卖股票差价收入	-2,186,202.73

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无权证投资收益。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	476,206.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	476,206.36

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-6,875,196.82
——股票投资	-6,875,196.82
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-6,875,196.82

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,013.82
合计	12,013.82

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	55,580.08
银行间市场交易费用	-
合计	55,580.08

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	27,349.14
信息披露费	69,616.82
指数使用费	100,100.00
合计	197,065.96

#### 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

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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其他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
浙商基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
华夏银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
浙商证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
通联资本管理有限公司	基金管理人的股东
浙江浙大网新集团有限公司	基金管理人的股东
养生堂有限公司	基金管理人的股东

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

本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及去年同期均没有应支付关联方的佣金。

### 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	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	269,984.74	332,619.31
其中：支付销售机构的客户维护费	33,896.18	86,960.56

注：支付基金管理人浙商基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.0%的年费率计提，每日计提，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	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	59,396.66	73,176.28

注：支付基金托管人华夏银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，每日计提，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。



### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

### 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

本基金本报告期及去年同期均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

### 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期间未持有本基金。

#### 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

### 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	3,753,828.71	13,318.12	4,742,448.69	18,448.16

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及去年同期均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金于本期间未进行利润分配，该处理符合基金利润分配原则。

### 6.4.12 期末（2016 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

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，应当承诺获得网下配售的股票持有期限不少于 3 个月，持有期自公开发行的股票上市之日起计算。基金通过网上申购获配的新股，从新股获配日至该新股上市日期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。截至本报告期末，本基金未因认购新发或增发证券而持有流通受限证券。

#### 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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科 A	2015 年 12 月 18 日	重大资产重组	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.99	48,290	651,029.89	878,878.00	-
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	重大事项	19.22	-	-	32,998	635,453.29	634,221.56	未复牌
600019	宝钢股份	2016 年 6 月 27 日	重大资产重组	4.90	-	-	31,385	187,723.43	153,786.50	未复牌
002465	海格通信	2016 年 6 月 13 日	重大事项	12.44	-	-	10,566	155,855.84	131,441.04	未复牌
600649	城投控股	2016 年 6 月 20 日	重大事项	14.36	-	-	8,714	111,106.75	125,133.04	未复牌
000728	国元证券	2016 年 6 月 8 日	重大事项	16.72	2016 年 7 月 8 日	17.37	7,136	149,107.37	119,313.92	-

002065	东华软件	2015年12月22日	重大事项	25.10	2016年7月4日	22.59	4,689	105,125.51	117,693.90	-
600005	武钢股份	2016年6月27日	重大资产重组	2.76	-	-	28,000	112,733.93	77,280.00	未复牌
000415	渤海金控	2016年2月1日	重大资产重组	6.82	2016年8月11日	7.50	11,312	94,217.94	77,147.84	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	8.29	-	-	8,363	106,711.44	69,329.27	未复牌
000629	*ST 钒钛	2016年5月26日	重大资产重组	2.39	-	-	26,589	86,975.47	63,547.71	未复牌

注：截至本报告批准报出日，“格力电器，宝钢股份，海格通信，城投控股，武钢股份，中环股份，\*ST 钒钛”仍未复牌。

### 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，本基金未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

### 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

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，浙商稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征；浙商进取份额具有高风险、高预期收益的特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资及股指期货投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进

行相应调整，力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

本基金的基金管理人建立了以合规与风险控制委员会为核心的，由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部、金融工程小组和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向合规与风险控制委员会提交独立的监察稽核报告和建议；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与金融工程小组负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行华夏银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金为全被动的指数基金，其主要资产都将用于跟踪组合的构建。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 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	3,753,828.71	-	-	-	-	-	3,753,828.71
存出保证金	13,284.06	-	-	-	-	-	13,284.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	49,564,139.24	49,564,139.24
应收利息	-	-	-	-	-	714.99	714.99
应收申购款	-	-	-	-	-	429.48	429.48
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,767,112.77	-	-	-	-	49,565,283.71	53,332,396.48
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	25.27	25.27
应付赎回款	-	-	-	-	-	25,661.09	25,661.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	43,412.85	43,412.85
应付托管费	-	-	-	-	-	9,550.81	9,550.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,947.81	14,947.81
其他负债	-	-	-	-	-	247,762.58	247,762.58
负债总计	-	-	-	-	-	341,360.41	341,360.41
利率敏感度缺口	3,767,112.77	-	-	-	-	-49,223,923.30	52,991,036.07
上年度末 2015 年 12 月 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	2,921,128.17	-	-	-	-	-	2,921,128.17
结算备付金	9,842.20	-	-	-	-	-	9,842.20
存出保证金	83,810.46	-	-	-	-	-	83,810.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-	57,949,168.19	57,949,168.19
应收证券清算款	-	-	-	-	-	468,217.35	468,217.35
应收利息	-	-	-	-	-	1,336.74	1,336.74
应收申购款	-	-	-	-	-	39,779.34	39,779.34
资产总计	3,014,780.83	-	-	-	-	58,458,501.62	61,473,282.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	37,425.69	37,425.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	52,444.59	52,444.59
应付托管费	-	-	-	-	-	11,537.81	11,537.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	44,257.01	44,257.01

其他负债	-	-	-	-	-	285,740.98	285,740.98
负债总计	-	-	-	-	-	431,406.08	431,406.08
利率敏感度缺口	3,014,780.83	-	-	-	-	-58,027,095.54	61,041,876.37

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金为全被动的指数基金，其主要资产都将用于跟踪组合的构建。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	49,564,139.24	93.53	57,949,168.19	94.93
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	49,564,139.24	93.53	57,949,168.19	94.93

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下降 5%	-2,661,004.10	-3,187,204.25
沪深 300 指数上升 5%	2,661,004.10	3,187,204.25	

注：本基金以沪深 300 指数作为其他价格波动风险的敏感度分析基准。

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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	49,564,139.24	92.93



	其中：股票	49,564,139.24	92.93
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	3,753,828.71	7.04
7	其他各项资产	14,428.53	0.03
8	合计	53,332,396.48	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	50,908.13	0.10
B	采矿业	1,701,900.18	3.21
C	制造业	16,288,607.18	30.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,191,155.82	4.13
E	建筑业	1,763,646.46	3.33
F	批发和零售业	1,060,124.33	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,677,353.69	3.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,233,003.07	4.21
J	金融业	17,904,375.83	33.79
K	房地产业	2,595,661.80	4.90
L	租赁和商务服务业	571,878.21	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	384,647.66	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	97,352.45	0.18
R	文化、体育和娱乐业	839,888.89	1.58
S	综合	203,635.54	0.38

	合计	49,564,139.24	93.53
--	----	---------------	-------

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末未持有沪港通投资股票投资组合。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	63,928	2,048,253.12	3.87
2	600016	民生银行	139,915	1,249,440.95	2.36
3	601166	兴业银行	79,345	1,209,217.80	2.28
4	600036	招商银行	67,536	1,181,880.00	2.23
5	601328	交通银行	163,916	922,847.08	1.74
6	000002	万科A	48,290	878,878.00	1.66
7	600519	贵州茅台	2,977	869,045.84	1.64
8	600000	浦发银行	51,677	804,610.89	1.52
9	600030	中信证券	45,969	746,076.87	1.41
10	601288	农业银行	229,708	735,065.60	1.39
11	600837	海通证券	47,409	731,046.78	1.38
12	601398	工商银行	145,602	646,472.88	1.22
13	000651	格力电器	32,998	634,221.56	1.20
14	601169	北京银行	60,848	630,993.76	1.19
15	600887	伊利股份	36,348	605,921.16	1.14
16	601601	中国太保	18,873	510,325.92	0.96
17	601766	中国中车	55,219	506,358.23	0.96
18	600900	长江电力	39,844	497,651.56	0.94
19	601668	中国建筑	90,276	480,268.32	0.91
20	000001	平安银行	54,278	472,218.60	0.89
21	000333	美的集团	19,359	459,195.48	0.87
22	601988	中国银行	127,358	408,819.18	0.77
23	600104	上汽集团	19,917	404,115.93	0.76
24	000858	五粮液	11,496	373,964.88	0.71
25	601688	华泰证券	19,384	366,745.28	0.69
26	601818	光大银行	96,508	362,870.08	0.68
27	601989	中国重工	57,308	362,759.64	0.68
28	600048	保利地产	39,598	341,730.74	0.64

29	600276	恒瑞医药	8,484	340,293.24	0.64
30	000725	京东方 A	145,647	336,444.57	0.63
31	600028	中国石化	64,099	302,547.28	0.57
32	000776	广发证券	17,803	298,378.28	0.56
33	600518	康美药业	19,120	290,432.80	0.55
34	002142	宁波银行	19,648	290,397.44	0.55
35	600999	招商证券	17,367	286,555.50	0.54
36	002304	洋河股份	3,735	268,621.20	0.51
37	600958	东方证券	15,900	267,279.00	0.50
38	002450	康得新	15,263	260,997.30	0.49
39	002594	比亚迪	4,261	259,963.61	0.49
40	002024	苏宁云商	22,959	249,334.74	0.47
41	002415	海康威视	11,308	242,669.68	0.46
42	601390	中国中铁	34,575	240,987.75	0.45
43	601006	大秦铁路	36,880	237,507.20	0.45
44	000166	申万宏源	27,161	228,424.01	0.43
45	601939	XD 建设银	47,657	226,370.75	0.43
46	000783	长江证券	19,344	224,390.40	0.42
47	601857	中国石油	30,157	218,035.11	0.41
48	600795	国电电力	73,262	214,657.66	0.41
49	601186	中国铁建	21,521	214,349.16	0.40
50	601628	中国人寿	10,238	213,155.16	0.40
51	601377	兴业证券	28,729	212,307.31	0.40
52	000063	中兴通讯	14,714	210,998.76	0.40
53	601009	南京银行	22,453	210,833.67	0.40
54	601336	新华保险	5,162	208,544.80	0.39
55	000538	云南白药	3,222	207,174.60	0.39
56	600050	XD 中国联	52,998	201,922.38	0.38
57	601985	中国核电	29,400	200,802.00	0.38
58	600637	东方明珠	8,234	199,839.18	0.38
59	600011	华能国际	26,281	197,633.12	0.37
60	601901	方正证券	25,342	194,119.72	0.37
61	600066	宇通客车	9,752	193,089.60	0.36
62	000625	长安汽车	14,062	192,227.54	0.36
63	600585	海螺水泥	12,416	180,528.64	0.34
64	600010	包钢股份	61,886	176,993.96	0.33
65	000423	东阿阿胶	3,340	176,452.20	0.33
66	601088	中国神华	12,451	175,185.57	0.33
67	300024	机器人	6,819	173,134.41	0.33

68	601099	太平洋	28,190	172,804.70	0.33
69	600690	青岛海尔	19,396	172,236.48	0.33
70	601211	国泰君安	9,500	169,005.00	0.32
71	600893	中航动力	4,868	168,676.20	0.32
72	002241	歌尔股份	5,835	167,347.80	0.32
73	600705	中航资本	28,180	165,698.40	0.31
74	600271	航天信息	6,812	162,125.60	0.31
75	600009	上海机场	6,105	159,035.25	0.30
76	600029	南方航空	22,334	157,678.04	0.30
77	600703	三安光电	7,827	156,305.19	0.29
78	000100	TCL 集团	47,266	155,505.14	0.29
79	600019	宝钢股份	31,385	153,786.50	0.29
80	600109	国金证券	11,318	152,566.64	0.29
81	002202	金风科技	10,014	151,511.82	0.29
82	601669	中国电建	26,341	150,407.11	0.28
83	300104	乐视网	2,811	148,730.01	0.28
84	600383	金地集团	14,354	148,707.44	0.28
85	300070	碧水源	9,817	146,076.96	0.28
86	600535	天士力	4,066	145,400.16	0.27
87	600886	国投电力	21,810	143,946.00	0.27
88	600115	东方航空	21,705	143,470.05	0.27
89	601727	上海电气	18,909	142,952.04	0.27
90	600089	特变电工	16,537	140,895.24	0.27
91	000768	中航飞机	7,136	140,507.84	0.27
92	600196	复星医药	7,368	140,139.36	0.26
93	600340	华夏幸福	5,652	137,795.76	0.26
94	601888	中国国旅	3,118	137,129.64	0.26
95	601600	中国铝业	36,267	136,726.59	0.26
96	000568	泸州老窖	4,582	136,085.40	0.26
97	300059	东方财富	6,115	135,753.00	0.26
98	000069	华侨城 A	21,152	135,372.80	0.26
99	600177	雅戈尔	9,746	134,397.34	0.25
100	000895	双汇发展	6,397	133,569.36	0.25
101	601607	上海医药	7,391	133,407.55	0.25
102	600023	浙能电力	26,102	132,859.18	0.25
103	002252	上海莱士	3,514	132,407.52	0.25
104	600804	鹏博士	7,245	132,076.35	0.25
105	002465	海格通信	10,566	131,441.04	0.25
106	000793	华闻传媒	13,284	131,245.92	0.25

107	600867	通化东宝	6,256	129,436.64	0.24
108	600369	西南证券	17,814	129,329.64	0.24
109	600118	中国卫星	3,815	128,184.00	0.24
110	600660	福耀玻璃	9,057	126,798.00	0.24
111	600061	国投安信	7,100	126,522.00	0.24
112	600406	国电南瑞	9,441	126,226.17	0.24
113	600352	浙江龙盛	14,634	126,145.08	0.24
114	601919	中国远洋	24,800	125,984.00	0.24
115	601788	光大证券	7,400	125,356.00	0.24
116	600649	城投控股	8,714	125,133.04	0.24
117	600208	新湖中宝	29,569	125,076.87	0.24
118	002236	大华股份	9,515	124,646.50	0.24
119	600031	三一重工	24,700	123,994.00	0.23
120	601018	宁波港	24,921	123,358.95	0.23
121	600739	辽宁成大	7,849	122,208.93	0.23
122	600221	海南航空	38,299	121,407.83	0.23
123	002736	国信证券	7,035	121,353.75	0.23
124	600309	万华化学	6,924	119,785.20	0.23
125	002475	立讯精密	6,082	119,511.30	0.23
126	000728	国元证券	7,136	119,313.92	0.23
127	300124	汇川技术	6,140	119,116.00	0.22
128	000157	中联重科	28,818	119,018.34	0.22
129	600718	东软集团	6,480	118,713.60	0.22
130	601618	中国中冶	32,100	118,449.00	0.22
131	600674	川投能源	14,316	118,250.16	0.22
132	002065	东华软件	4,689	117,693.90	0.22
133	000623	吉林敖东	4,636	115,668.20	0.22
134	000540	中天城投	18,452	114,955.96	0.22
135	601998	中信银行	20,023	113,530.41	0.21
136	600741	华域汽车	8,090	113,340.90	0.21
137	601111	XD 中国国	16,760	113,297.60	0.21
138	000630	铜陵有色	44,219	112,316.26	0.21
139	000338	潍柴动力	14,342	112,011.02	0.21
140	002739	万达院线	1,400	111,860.00	0.21
141	601933	永辉超市	26,876	110,997.88	0.21
142	600415	小商品城	17,938	110,856.84	0.21
143	000876	新希望	13,214	109,940.48	0.21
144	600018	上港集团	21,468	109,486.80	0.21
145	002385	大北农	13,564	109,325.84	0.21

146	600085	同仁堂	3,662	109,090.98	0.21
147	603993	洛阳钼业	26,146	108,505.90	0.20
148	002081	金螳螂	10,733	107,544.66	0.20
149	600663	陆家嘴	4,665	106,128.75	0.20
150	600068	XD 葛洲坝	18,221	106,046.22	0.20
151	601800	XD 中国交	10,049	105,815.97	0.20
152	000046	泛海控股	10,400	105,144.00	0.20
153	300003	乐普医疗	5,754	104,952.96	0.20
154	002673	西部证券	4,056	104,888.16	0.20
155	000826	启迪桑德	3,378	103,197.90	0.19
156	600570	恒生电子	1,540	102,825.80	0.19
157	600150	中国船舶	4,595	102,284.70	0.19
158	000963	华东医药	1,513	101,976.20	0.19
159	600583	海油工程	14,707	101,625.37	0.19
160	600398	海澜之家	8,953	101,168.90	0.19
161	001979	招商蛇口	7,054	100,519.50	0.19
162	600157	永泰能源	24,978	98,413.32	0.19
163	600816	安信信托	5,800	97,846.00	0.18
164	300015	爱尔眼科	2,665	97,352.45	0.18
165	000402	金融街	10,004	97,238.88	0.18
166	601899	紫金矿业	28,785	97,005.45	0.18
167	300017	网宿科技	1,440	96,768.00	0.18
168	002007	华兰生物	3,065	96,241.00	0.18
169	600588	用友网络	4,864	95,237.12	0.18
170	000750	国海证券	12,757	94,274.23	0.18
171	000977	浪潮信息	4,000	93,800.00	0.18
172	600060	海信电器	5,263	93,049.84	0.18
173	601106	中国一重	17,800	92,738.00	0.18
174	600895	张江高科	5,100	92,208.00	0.17
175	002152	广电运通	5,600	92,064.00	0.17
176	300058	蓝色光标	9,399	91,264.29	0.17
177	600688	上海石化	14,850	90,585.00	0.17
178	601333	广深铁路	22,999	89,926.09	0.17
179	002422	科伦药业	5,808	89,501.28	0.17
180	600820	隧道股份	10,600	88,934.00	0.17
181	600332	白云山	3,608	88,901.12	0.17
182	601098	中南传媒	4,899	88,720.89	0.17
183	000425	徐工机械	28,792	88,103.52	0.17
184	600642	申能股份	15,338	88,040.12	0.17

185	002230	科大讯飞	2,674	87,840.90	0.17
186	600256	广汇能源	21,300	87,330.00	0.16
187	300144	宋城演艺	3,483	86,761.53	0.16
188	601866	中海集运	21,778	86,240.88	0.16
189	600111	北方稀土	6,469	86,102.39	0.16
190	002470	金正大	10,600	85,330.00	0.16
191	601258	庞大集团	30,938	85,079.50	0.16
192	000503	海虹控股	2,115	85,044.15	0.16
193	600547	山东黄金	2,152	83,734.32	0.16
194	600376	首开股份	7,500	83,400.00	0.16
195	600252	中恒集团	19,147	83,097.98	0.16
196	000738	中航动控	3,117	82,288.80	0.16
197	600027	华电国际	16,601	82,174.95	0.16
198	601555	东吴证券	6,094	81,659.60	0.15
199	000709	河钢股份	29,438	81,543.26	0.15
200	601718	际华集团	10,600	80,984.00	0.15
201	600875	东方电气	8,232	80,838.24	0.15
202	601991	大唐发电	20,700	80,523.00	0.15
203	600100	同方股份	5,235	78,315.60	0.15
204	600373	中文传媒	3,761	78,040.75	0.15
205	600362	江西铜业	5,777	77,873.96	0.15
206	300027	华谊兄弟	5,735	77,651.90	0.15
207	600005	武钢股份	28,000	77,280.00	0.15
208	000415	渤海金控	11,312	77,147.84	0.15
209	300133	华策影视	4,939	76,900.23	0.15
210	601021	春秋航空	1,600	76,704.00	0.14
211	600170	上海建工	19,848	76,017.84	0.14
212	000729	燕京啤酒	9,889	75,057.51	0.14
213	601117	中国化学	13,531	74,826.43	0.14
214	000039	中集集团	5,176	73,343.92	0.14
215	600037	歌华有线	4,800	73,008.00	0.14
216	601179	中国西电	14,368	72,845.76	0.14
217	000061	农产品	5,985	72,777.60	0.14
218	300251	光线传媒	6,240	72,134.40	0.14
219	600372	中航电子	3,673	71,513.31	0.13
220	601198	东兴证券	2,900	70,876.00	0.13
221	601633	长城汽车	8,391	70,820.04	0.13
222	000778	新兴铸管	15,224	70,639.36	0.13
223	601225	陕西煤业	13,612	70,374.04	0.13

224	601872	招商轮船	14,900	69,732.00	0.13
225	002129	中环股份	8,363	69,329.27	0.13
226	601992	金隅股份	8,847	68,564.25	0.13
227	000999	华润三九	2,828	68,494.16	0.13
228	601898	中煤能源	13,137	67,786.92	0.13
229	600038	中直股份	1,631	67,653.88	0.13
230	600008	首创股份	17,318	67,367.02	0.13
231	601216	君正集团	8,977	67,058.19	0.13
232	000839	中信国安	3,100	66,061.00	0.12
233	000712	锦龙股份	3,182	66,058.32	0.12
234	600827	百联股份	5,468	66,053.44	0.12
235	603000	人民网	3,948	65,576.28	0.12
236	000883	湖北能源	13,933	64,509.79	0.12
237	600863	内蒙华电	21,107	63,743.14	0.12
238	000629	*ST 钒钛	26,589	63,547.71	0.12
239	002456	欧菲光	2,153	63,513.50	0.12
240	000009	中国宝安	4,578	62,718.60	0.12
241	600021	上海电力	6,100	62,647.00	0.12
242	002146	荣盛发展	9,216	61,931.52	0.12
243	002153	石基信息	2,344	61,834.72	0.12
244	600485	信威集团	3,465	61,815.60	0.12
245	002294	信立泰	2,254	61,308.80	0.12
246	600153	建发股份	5,038	60,456.00	0.11
247	600959	江苏有线	4,300	60,028.00	0.11
248	300315	掌趣科技	5,703	59,824.47	0.11
249	601928	凤凰传媒	5,613	59,161.02	0.11
250	002008	大族激光	2,589	59,132.76	0.11
251	600600	青岛啤酒	2,022	58,779.54	0.11
252	601958	金钼股份	7,136	58,158.40	0.11
253	600489	中金黄金	5,141	57,784.84	0.11
254	000156	华数传媒	3,095	57,412.25	0.11
255	000027	深圳能源	8,790	56,080.20	0.11
256	002424	贵州百灵	3,200	55,040.00	0.10
257	600582	天地科技	12,200	54,900.00	0.10
258	000825	太钢不锈	17,202	54,358.32	0.10
259	000917	电广传媒	3,282	54,251.46	0.10
260	000898	鞍钢股份	14,092	53,972.36	0.10
261	600446	金证股份	1,500	53,925.00	0.10
262	601808	中海油服	4,421	53,715.15	0.10



263	002500	山西证券	3,239	53,637.84	0.10
264	601608	中信重工	9,900	53,163.00	0.10
265	002183	怡亚通	3,700	52,984.00	0.10
266	600648	外高桥	2,652	52,270.92	0.10
267	000686	东北证券	4,029	52,014.39	0.10
268	601118	海南橡胶	9,107	50,908.13	0.10
269	002399	海普瑞	2,898	50,599.08	0.10
270	600317	营口港	15,000	50,400.00	0.10
271	600098	广州发展	6,400	50,048.00	0.09
272	002292	奥飞娱乐	1,629	48,788.55	0.09
273	600783	鲁信创投	2,254	48,708.94	0.09
274	600839	四川长虹	10,998	48,611.16	0.09
275	000060	中金岭南	4,640	48,395.20	0.09
276	600685	中船防务	1,900	48,184.00	0.09
277	000792	盐湖股份	2,227	46,989.70	0.09
278	000413	东旭光电	5,419	46,549.21	0.09
279	600578	京能电力	10,839	46,390.92	0.09
280	600998	九州通	2,587	45,298.37	0.09
281	600074	保千里	2,800	41,776.00	0.08
282	600188	XD 兖州煤	3,420	37,414.80	0.07
283	300002	神州泰岳	3,498	37,218.72	0.07
284	600737	中粮屯河	3,100	35,805.00	0.07
285	600022	山东钢铁	14,900	35,313.00	0.07
286	600606	绿地控股	3,200	34,624.00	0.07
287	600873	梅花生物	5,515	34,248.15	0.06
288	600704	物产中大	3,530	33,040.80	0.06
289	002027	分众传媒	1,800	29,718.00	0.06
290	300146	汤臣倍健	2,128	28,813.12	0.05
291	002195	二三四五	2,334	28,684.86	0.05
292	000800	一汽轿车	2,491	27,102.08	0.05
293	600666	奥瑞德	700	24,332.00	0.05
294	300085	银之杰	800	23,920.00	0.05
295	601016	节能风电	2,400	23,832.00	0.04
296	600871	石化油服	5,400	20,736.00	0.04
297	002568	百润股份	600	13,200.00	0.02
298	603885	吉祥航空	500	13,125.00	0.02

## 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	601318	中国平安	554,138.00	0.91
2	600016	民生银行	455,613.00	0.75
3	600900	长江电力	342,272.00	0.56
4	601166	兴业银行	332,027.00	0.54
5	601328	交通银行	322,321.00	0.53
6	600036	招商银行	293,254.00	0.48
7	600000	浦发银行	292,266.00	0.48
8	600030	中信证券	289,973.00	0.48
9	600837	海通证券	236,889.00	0.39
10	601398	工商银行	224,685.00	0.37
11	601288	农业银行	205,794.00	0.34
12	600958	东方证券	201,969.00	0.33
13	601169	北京银行	182,000.00	0.30
14	600519	贵州茅台	169,474.00	0.28
15	601377	兴业证券	167,626.00	0.27
16	002739	万达院线	154,641.00	0.25
17	002736	国信证券	151,600.00	0.25
18	601668	中国建筑	149,226.00	0.24
19	601989	中国重工	134,529.00	0.22
20	601601	中国太保	132,470.00	0.22

### 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	600016	民生银行	803,537.00	1.32
2	601318	中国平安	571,735.00	0.94
3	600000	浦发银行	448,519.00	0.73
4	601166	兴业银行	336,343.00	0.55
5	600036	招商银行	326,610.92	0.54

6	600030	中信证券	313,157.00	0.51
7	600837	海通证券	256,679.00	0.42
8	300059	东方财富	214,981.94	0.35
9	600900	长江电力	208,167.00	0.34
10	601288	农业银行	195,390.00	0.32
11	601328	交通银行	192,257.00	0.31
12	600519	贵州茅台	188,137.00	0.31
13	601169	北京银行	178,999.00	0.29
14	002736	国信证券	162,673.59	0.27
15	001979	招商蛇口	158,181.29	0.26
16	002673	西部证券	157,097.01	0.26
17	601398	工商银行	149,908.00	0.25
18	600111	北方稀土	148,986.88	0.24
19	300104	乐视网	148,089.00	0.24
20	601668	中国建筑	147,438.00	0.24

### 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

买入股票成本（成交）总额	18,480,611.17
卖出股票收入（成交）总额	17,804,240.57

“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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。

### 7.5 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持有贵金属。

## 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.10.2 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。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.11.2

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。

### 7.11.3 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	13,284.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	714.99
5	应收申购款	429.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,428.53

### 7.11.4 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。

## 7.11.5 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	000002	万 科 A	878,878.00	1.66	筹划重大资产重组

## 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 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

份额级别	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
浙商稳健	129	23,633.42	2,548,216.00	83.58%	500,495.00	16.42%
浙商进取	331	9,210.61	50,607.00	1.66%	2,998,105.00	98.34%
浙商沪深 300 指数分级	1,550	28,166.39	30,107,525.00	68.96%	13,550,381.88	31.04%
合计	2,010	24,753.90	32,706,348.00	65.73%	17,048,981.88	34.27%

注：对于浙商沪深 300、浙商稳健和浙商进取份额，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数据，比例的分母采用期末基金份额总额。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

浙商稳健

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	民生通惠资产—中信银行—民生通惠聚利 3 号资产管理产品	2,494,516.00	81.82%
2	温晓文	83,700.00	2.75%

3	潘苏英	61,000.00	2.00%
4	张焕君	60,000.00	1.97%
5	德邦基金—招商银行—中泰稳盈回报 1 号资产管理计划	53,000.00	1.74%
6	张慧章	43,000.00	1.41%
7	王丹	24,750.00	0.81%
8	温金谟	20,100.00	0.66%
9	梁世立	20,000.00	0.66%
10	郑建伟	19,290.00	0.63%

浙商进取

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	左慧玲	234,669.00	7.70%
2	黎明星	222,900.00	7.31%
3	刘晓亮	207,822.00	6.82%
4	单继荣	155,800.00	5.11%
5	周锐	150,000.00	4.92%
6	李红	113,000.00	3.71%
7	刘巍	83,400.00	2.74%
8	骆漫开	74,400.00	2.44%
9	颜爱花	71,700.00	2.35%
10	王素珍	70,900.00	2.33%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 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的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浙商稳健	浙商进取	浙商沪深 300 指数分级
基金合同生效日（2012 年 5 月 7 日） 基金份额总额	9,136,705.00	9,136,706.00	336,090,191.17
本报告期期初基金份额总额	2,750,056.00	2,750,057.00	41,924,165.28
本报告期基金总申购份额	3,602,772.00	3,602,772.00	18,734,051.04
减：本报告期基金总赎回份额	3,304,117.00	3,304,117.00	17,000,309.44

本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,048,711.00	3,048,712.00	43,657,906.88

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。C 类拆分变动份额包含本期定期份额折算的变动份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

2016 年 1 月 13 日，郭乐琦女士就任浙商基金管理有限公司督察长职务，原督察长闻震宙先生于同日离职。

2016 年 4 月 14 日，托管人华夏银行股份有限公司在网站披露了《华夏银行股份有限公司关于资产托管部高级管理人员变更的公告》。经中国证券投资基金业协会批准备案，聘任陈秀良先生和徐昊光先生为资产托管部副总经理，毛剑鸣先生不再担任资产托管部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

### 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
上海证券	1	24,752,888.43	68.27%	23,053.95	66.71%	-
招商证券	1	11,503,597.71	31.73%	11,504.49	33.29%	-
国都证券	1	-	-	-	-	-

### 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的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
上海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

#### 1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 遵循国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定的要求；
- (2) 维护持有人利益，不利用基金资产进行利益输送，不承诺交易量；
- (3) 以券商服务质量作为席位选择和佣金分配的标准。

#### 2、券商专用交易单元选择程序：

##### (1) 投资管理部、市场部

a、专员与券商联系商讨合作意向，根据公司及基金法律文件中对券商席位的选择标准，并参考中央交易室主管的建议，确定新基金租用或基金新租用席位的所属券商以及（主）席位。

b、报公司分管领导审核通过。

##### (2) 中央交易室

a、专员将我公司格式版本的《证券交易席位使用协议》发送给券商相关业务联系人。

b、券商对我公司提供的协议有修改意见的，其内容若涉及投资管理部、市场部、运营保障部的，由专员分别将此内容发送给上述部门审议，并由专员将我公司各职能部门反馈的意见与券商进行商议，形成一致意见后完成协议初稿，交我公司监察稽核部审核。

c、对券商和我公司双方同意的协议文本进行签字盖章。我盖章程序，由专员填写合同流转单，



分别送达投资管理部、市场部、运营保障部、监察稽核部签字，最后盖章。

3、本期内本基金券商交易单元变更情况：

(1) 租用券商交易单元未发生变动。

## 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	浙商基金 2015 年度最后一个交易日基金资产净值等公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 1 日
2	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之浙商稳健份额 2016 年度约定年基准收益率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 4 日
3	浙商基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 4 日
4	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间浙商稳健份额停复牌的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 5 日
5	浙商基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 6 日
6	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金定期折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 6 日
7	关于浙商稳健定期份额折算后次日收盘价调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 6 日
8	浙商基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 7 日
9	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持万科 A (000002) 股票估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 9 日
10	关于浙商基金管理有限公司旗下部分基金净值揭示异常的提示	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 13 日
11	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 22 日
12	浙商基金关于旗下部分基金在平	《中国证券报》、《上	2016 年 2 月 22 日

	安证券开通定期定额投资的公告	海证券报》、《证券时报》	
13	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持泰格医药（300347）股票估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 29 日
14	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 25 日
15	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 25 日
16	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司开展的电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 1 日
17	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 21 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浙商沪深 300 指数分级证券投资基金设立的相关文件；
- 2、《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 3、《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》；
- 4、《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 11.2 存放地点

浙江省杭州市西湖区教工路 18 号世贸丽晶城欧美中心 B 座 507 室

### 11.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.zsfund.com](http://www.zsfund.com) 查阅，

还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-067-9908/021-60359000 查询相关信息。

浙商基金管理有限公司  
2016 年 8 月 24 日