

浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告

2017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：平安银行股份有限公司

送出日期：2018年3月30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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

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。本报告期自2017年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§4	管理人报告	9
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	10
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6	审计报告	14
6.1	审计报告基本信息	14
6.2	审计报告的基本内容	14
§7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4	报表附注	22
§8	投资组合报告	45
8.1	期末基金资产组合情况	45
8.2.1	报告期末按行业分类的境内股票投资组合	46
8.3	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	47
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	48
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	58
8.6	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	58
8.7	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	58
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	58
8.9	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	58
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12	投资组合报告附注	59
§9	基金份额持有人信息	60
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60

9.3 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 .....	60
§10 开放式基金份额变动 .....	60
§11 重大事件揭示 .....	61
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
11.8 其他重大事件 .....	63
§13 备查文件目录 .....	67
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	68
13.3 查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	浙商汇金转型升级
基金主代码	001604
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3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	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	15,483,529.61
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结构转型推动产业升级相关的上市公司，通过精选个股和严格控制组合风险，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将充分发挥管理人的投资研究优势，挖掘出受益于中国经济转型和产业升级的上市公司进行投资，力求基金资产的长期稳健增值。</p> <p>本基金将根据投资研究团队的分析，综合宏观经济数据和微观经济数据，基于经济周期运行规律，预估市场未来的发展，并有效判断上市公司业绩和股票价格的变化关系。</p> <p>通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互补的研究手段，选择出受益于宏观经济发展趋势的行业和公司，并根据市场热点的变化进行调整，合理配置基金资产中股票和债券等资产的比例，采用动态调整策略优化组合，有效的控制不同市场形势下的风险和收益水平。</p>
业绩比较基准	中证800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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌
	联系电话	0571-87901630
	电子邮箱	fangbin@stocke.com.cn
客户服务电话	95345	95511-3
传真	0571-87902581	0755-82080387
注册地址	杭州市下城区天水巷25号	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址	杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
邮政编码	310020	518001
法定代表人	李雪峰	谢永林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	浙江省杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7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
会计师事务所	北京兴华会计师事务所(特殊)	北京市西城区裕民路18号北环中

	普通合伙)	心22层
注册登记机构	浙江浙商证券资产管理有限 公司	杭州市江干区五星路201号浙商 证券大楼7楼

### § 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	2017年	2016年2月3日-2016年 12月31日
本期已实现收益	177,771.55	-1,158,326.36
本期利润	1,081,904.39	-1,872,431.52
加权平均基金份额本期利润	0.0157	-0.0177
本期加权平均净值利润率	1.60%	-1.77%
本期基金份额净值增长率	3.75%	-4.00%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	-54,396.45	-2,378,901.12
期末可供分配基金份额利润	-0.0035	-0.0403
期末基金资产净值	15,429,133.16	56,674,230.87
期末基金份额净值	0.996	0.960
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	-0.40%	-4.00%

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。

#### 3.2 基金净值表现

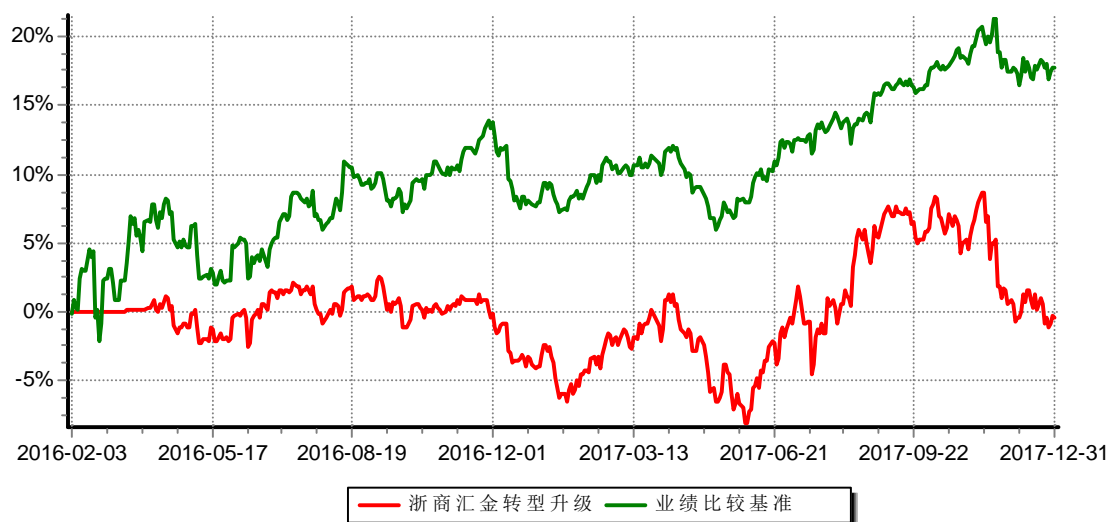
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	-5.86%	0.91%	1.08%	0.53%	-6.94%	0.38%
过去六个月	0.50%	0.94%	4.80%	0.48%	-4.30%	0.46%
过去一年	3.75%	0.85%	9.07%	0.46%	-5.32%	0.39%
自基金合同生效日起 至今（2016年02月03 日-2017年12月31日）	-0.40%	0.71%	17.79%	0.65%	-18.19%	0.06%

注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-4.00%，同期业绩比较基准收益率为17.79%。

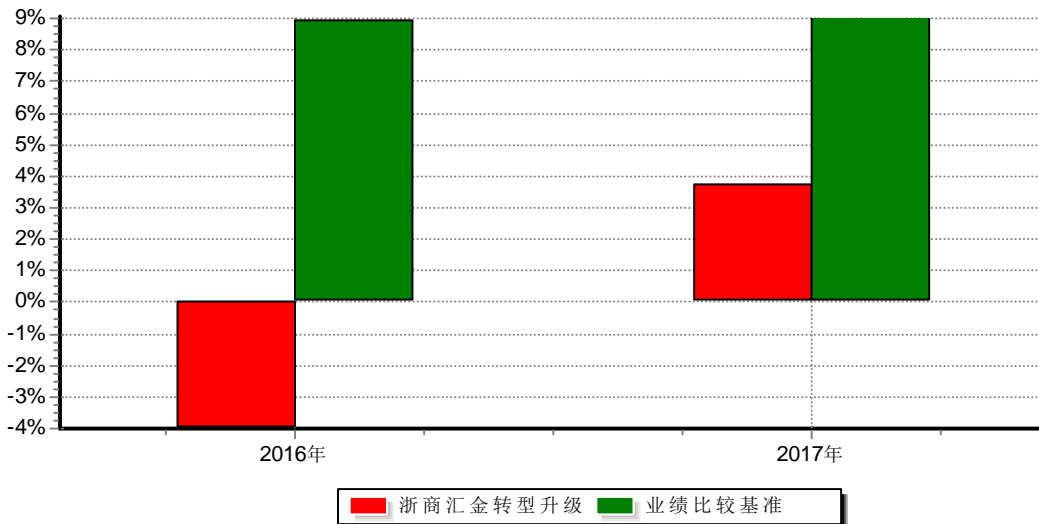
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金合同生效日为2016年2月3日。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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2016年2月3日(基金合同生效日)至2017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2017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、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金鼎盈定期灵活配置混合型证券投资基金和浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金。

#### 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		
赵语涛	本基金基金经理；浙商汇金转型成长基金和浙商汇金鼎盈定增基金基金经理。	2016年2月29日	—	9年	博士，曾任东海证券有限责任公司研究所研究员；海通证券股份有限公司资产管理部研究员；兴业基金管理有限公司研究员；浙江浙商证券资产管理有限公司基金经理助理；现任浙商汇金转型成长基金、浙商汇金转型升级基金及浙商汇金鼎盈定增基金基金经理。
马斌博	本基金基金经理	2017年12月27日	—	6年	硕士，曾任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司研究员；浙江浙商证券资产管理有限公司研究部研究员；现任本基金基金经理。

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升级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》、《浙商汇金转型升级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，为基金持有人谋求基金资产的长期稳定增长，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**

本产品在一季度把握住了一些结构性的机会，着重中期和提前的布局，在个股选择上注重性价比。进入二季度，进行了行业的调整，去杠杆带来的市场综合反应，净值有所回撤。三季度比较成功的布局了低估的成长股，净值有所提升，并注意了控制回撤。四季度出现回撤，主要是由于仓位较高，在监管和流动性带来的冲击下出现较大回撤，持股中仍偏重性价比，对于核心品种仍坚持信心持有。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2017年12月31日，本基金份额净值为0.996元，份额累计净值为0.996元。报告期内，本基金份额净值增长率为3.75%，同期业绩基准增长率9.07%。

### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

从目前宏观经济运行态势看，国内经济目前而言仍显示了充足的韧性，海外复苏拉动的出口持续向好，国内固定资产投资增速趋缓，但无失速风险，消费升级过程消费对GDP的贡献趋升，宏观经济仍沿着复苏趋势运行。展望18年，CPI阶段性高企已逐步成为共识，不确定的是通胀翘头的节奏、力度以及持续时间；国内投资方面，由于低库存的现实，尽管“房住不炒”的总基调没有变化，地产投资的增速仍不差，反而由于政府财政压力以及中央对基础设施冗余建设的担忧，基建投资的下行压力较大，对18年下半年经济运行构成一定压力；全球视野看，全球经济复苏已从美国向欧日扩散，拉动中国出口对经济贡献，但美元趋势性贬值过程中人民币的升值对出口的影响需要细致观察。整体而言，18年国内以及全球宏观经济仍将沿着17年的复苏轨迹惯性向上，所不同的是随着PPI向CPI的传导，通胀压力逐步显现，经济高位持续景气的持续性有待观察。

17年以来美股、港股持续走牛，A股沪深300为代表的蓝筹股也走出慢牛行情，经济持续复苏，上市公司业绩持续提升是17年以来全球权益市场走牛的主要驱动力。同时在利率上行周期中，市场追逐当下、确定资产，对远期、不确定资产谨慎，这也是A股上证50和沪深300与创业板指、中证1000走出背离走势的主要原因。进入18年，市场延续了17年的整体风格，同时在金融去杠杆继续深化的背景下，将此种风格演绎到极致，银行、地产、消费轮番表现。进入2月份，美股系统性下杀，背后的基本逻辑是持续走牛多年后，随着无风险利率水平的抬升，股票开始表现出对利率的敏感性。未来市场波动率会显著加大，18年整体操作难度应该会显著高于17年。展望18年，金融去杠杆大方向已定，叠加PPI向CPI的价格传导，通胀压力渐显，市场利率易上难下，在经济基本面韧性充足的预期下，金融、地产、各行业龙头仍将是A股市场的基石和主线。同时也注意到创业板蓝筹的轮番活跃，未来符合政策引导方向、自身行业趋势向上的新兴成长板块有望走出趋势性行情。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017年，本基金管理人内部监察稽核工作坚持规范运作、防范风险、维护投资人利益的原则，在进一步完善、优化公司内控制度的基础上，严格依据法律法规和公司内控制度监督前后台各部门日常工作，切实防控公司运营和投资组合运作的风险，保障公司稳步发展。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作主要包括以下几个方面：

一、进一步完善、优化公司内控制度，加强监察稽核力度。

报告期内，公司制定或修订了《流动性风险管理办法》、《流动性风险应急及危机报告制度》、《全面风险管理办法（修订）》、《市场风险管理办法（试行）》、《固定收益类产品流动性风险管理办法》、《信用风险管理办法（试行）》、《压力测试管理办法（修订）》、《操作风险管理办法（试行）》、《合规管理制度》、《合规风控专员管理办法》、《合规风控考核管理办法（修订）》等制度，进一步完善了公司规章

制度体系，有效保障了公司相关机构职能的发挥及业务的发展。同时，合规风控部继续严格依据法律法规和公司规章制度独立行使职责，通过定期或不定期检查、专项检查等方式，监督公司各项制度执行情况，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

## 二、继续加强投资监控，防范投资运作风险。

报告期内，合规风控部通过现场检查、电脑实时监控、人员询问、重点抽查等方式，加强事前、事中、事后的风险管理，同时通过定期对投资组合进行量化风险分析和绩效评估并提供风险分析报告和绩效评估报告等方式进行风险控制，切实贯彻落实公平交易，防范异常交易，确保公司旗下投资组合合法合规运作，切实维护投资人的合法利益。

报告期内，本基金管理人所管理基金的运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，不断完善和优化操作流程，充实和改进内控技术方法与手段，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，防范和控制各种风险，合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

### 4.7 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。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《浙商汇金转型升级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。

### 4.9 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，本基金持续出现基金资产净值低于5000万元的情形，已上报中国证券监督管理委员会，公司正在推进相关应对方案,本基金未出现基金持有人低于200人的情

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

本报告期，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本报告期内，由浙江浙商证券资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、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）、投资组合报告等内容真实、准确、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	[2018]京会兴审字第14020044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	浙商汇金转型升级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升级灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“汇金转型升级灵活配置混合型基金”)财务报表，包括2017年12月31日

	<p>的资产负债表以及2017年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p>
<p>管理层对财务报表的责任段</p>	<p>汇金转型升级灵活配置混合型基金的基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协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，使其实现公允反映，并设计、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>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇金转型升级灵活配置混合型基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算汇金转型升级灵活配置混合型基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督汇金转型升级灵活配置混合型基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师的责任段</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由</p>

	<p>于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇金转型升级灵活配置混合型基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致汇金转型升级灵活配置混合型基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>审计意见段</p>	<p>我们认为，汇金转型升级灵活配置混合型基金财务报表在所有重大方面按照财政部于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&lt;年度报告和半年报告&gt;》、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》编制，公允反映了汇金转型升级灵活配置混合型基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了</p>



	<p>审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇金转型升级灵活配置混合型基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
注册会计师的姓名	张庆栾、李 鑫
会计师事务所的名称	北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	北京市西城区裕民路18号北环中心22层
审计报告日期	2018-02-09

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,072,254.81	5,290,280.29
结算备付金		616,979.59	2,804,443.88
存出保证金		72,133.71	104,510.66
交易性金融资产	7.4.7.2	11,948,394.00	49,152,205.55
其中：股票投资		11,948,394.00	49,152,205.55
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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,900,000.00	—
应收证券清算款		186,328.33	—
应收利息	7.4.7.5	-201.26	4,930.53
应收股利		—	—
应收申购款		7,988.02	1,555,666.01
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		15,803,877.20	58,912,036.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 2016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	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		141,800.80	1,408,410.84
应付赎回款		101,531.80	607,439.51
应付管理人报酬		23,006.24	70,667.88
应付托管费		3,834.36	11,777.98
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	34,081.83	76,920.50
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	70,489.01	62,589.34
负债合计		374,744.04	2,237,806.05
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	7.4.7.9	15,483,529.61	59,053,131.99
未分配利润	7.4.7.10	-54,396.45	-2,378,901.12
所有者权益合计		15,429,133.16	56,674,230.87
负债和所有者权益总计		15,803,877.20	58,912,036.92

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值0.996元，基金份额总额15,483,529.61份。

## 7.2 利润表

会计主体：浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016 年12月31日
一、收入		4,454,520.35	835,854.85
1.利息收入		104,410.79	1,624,399.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	56,664.84	451,880.51
债券利息收入		—	158.60
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		47,745.95	1,172,360.87
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,214,051.65	-711,636.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,898,421.61	-918,566.07
基金投资收益	7.4.7.13	—	—
债券投资收益	7.4.7.14	—	5,498.21
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	7.4.7.15	—	—
衍生工具收益	7.4.7.16	—	—
股利收益	7.4.7.17	315,630.04	201,431.51

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	904,132.84	-714,105.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	231,925.07	637,196.38
<b>减：二、费用</b>		<b>3,372,615.96</b>	<b>2,708,286.37</b>
1. 管理人报酬		1,030,471.54	1,460,518.18
2. 托管费		171,745.26	243,419.61
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.20	1,992,399.16	836,848.58
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.21	178,000.00	167,500.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,081,904.39</b>	<b>-1,872,431.52</b>
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,081,904.39</b>	<b>-1,872,431.52</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017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)	59,053,131.99	-2,378,901.12	56,674,230.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	1,081,904.39	1,081,904.39
三、本期基金份额交易产生的	-43,569,602.38	1,242,600.28	-42,327,002.10

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	86,025,638.63	-2,209,554.84	83,816,083.79
2.基金赎回款	-129,595,241.01	3,452,155.12	-126,143,085.89
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)	15,483,529.61	-54,396.45	15,429,133.16
项 目	上年度可比期间 2016年2月3日至2016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)	242,073,014.91	—	242,073,014.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-1,872,431.52	-1,872,431.52
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)	-183,019,882.92	-506,469.60	-183,526,352.52
其中：1.基金申购款	7,310,384.09	-127,235.61	7,183,148.48
2.基金赎回款	-190,330,267.01	-379,233.99	-190,709,501.00
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)	59,053,131.99	-2,378,901.12	56,674,230.87

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**

浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会证监许可[2015]1343号《关于准予浙商汇金转型升级灵活配置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《浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》向社会公开发行募集。《浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年2月3日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为242,073,014.91份,相关募集业经北京兴华会计师事务所[2016]京会兴浙分验字第68000006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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

### **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2017年12月31日的财务状况以及2017年1月1日至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2017年1月1日至2017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

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。

#### 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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	1,072,254.81	5,290,280.29
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	1,072,254.81	5,290,280.29

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,758,366.32	11,948,394.00	190,027.68
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		11,758,366.32	11,948,394.00	190,027.68
项目		上年度末 2016年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		49,866,310.71	49,152,205.55	-714,105.16
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		49,866,310.71	49,152,205.55	-714,105.16

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,900,000.00	—
合计	1,900,000.00	—

注：本基金本报告期末，持有买入返售金融资产1900000元。上年度可比区间未持有任何买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	303.00	3,490.63
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	305.36	1,388.20
应收债券利息	—	—
应收买入返售证券利息	-845.37	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	35.75	51.70
合计	-201.26	4,930.53

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	34,081.83	76,920.50
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	34,081.83	76,920.50

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2017年12月31日	2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	189.01	2,289.34
预提费用	70,300.00	60,300.00
合计	70,489.01	62,589.34

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,053,131.99	59,053,131.99
本期申购	86,025,638.63	86,025,638.63
本期赎回（以“-”号填列）	-129,595,241.01	-129,595,241.01
本期末	15,483,529.61	15,483,529.61

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

#### 7.4.7.10 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	-1,393,524.34	-985,376.78	-2,378,901.12
本期利润	177,771.55	904,132.84	1,081,904.39
本期基金份额交易产生的变动数	1,612,334.73	-369,734.45	1,242,600.28
其中：基金申购款	-2,242,379.12	32,824.28	-2,209,554.84
基金赎回款	3,854,713.85	-402,558.73	3,452,155.12
本期已分配利润	—	—	—
本期末	396,581.94	-450,978.39	-54,396.45

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12

	月31日	月31日
活期存款利息收入	40,836.51	73,771.87
定期存款利息收入	—	315,800.00
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	13,801.62	61,245.05
其他	2,026.71	1,063.59
合计	56,664.84	451,880.51

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12月31日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	2,898,421.61	-918,566.07
股票投资收益——赎回差价 收入	—	—
股票投资收益——申购差价 收入	—	—
合计	2,898,421.61	-918,566.07

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	711,974,129.90	277,826,062.44
减：卖出股票成本总额	709,075,708.29	278,744,628.51
买卖股票差价收入	2,898,421.61	-918,566.07

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。



#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12 月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	—	5,498.21
债券投资收益——赎回差价 收入	—	—
债券投资收益——申购差价 收入	—	—
合计	—	5,498.21

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12 月31日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	—	683,331.52
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	—	675,257.50
减：应收利息总额	—	2,575.81
买卖债券差价收入	—	5,498.21

##### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资。

#### 7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资。

#### 7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资。

#### 7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12 月31日
股票投资产生的股利收益	315,630.04	201,431.51
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	315,630.04	201,431.51

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12 月31日
1.交易性金融资产	904,132.84	-714,105.16
——股票投资	904,132.84	-714,105.16
——债券投资	—	—
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
——贵金属投资	—	—

——其他	—	—
2.衍生工具	—	—
——权证投资	—	—
3.其他	—	—
合计	904,132.84	-714,105.16

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12 月31日
基金赎回费收入	231,925.07	637,196.38
合计	231,925.07	637,196.38

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12 月31日
交易所市场交易费用	1,992,399.16	836,848.58
银行间市场交易费用	—	—
合计	1,992,399.16	836,848.58

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12 月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	110,000.00	110,000.00
其他	18,000.00	4,500.00
银行结算费用	—	3,000.00

合计	178,000.00	167,500.00
----	------------	------------

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税【2016】36号）、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税【2016】140号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税【2017】2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税【2017】56号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税【2017】90号）及《中华人民共和国证券投资基金法》（2015年修订）中的规定，自2018年1月1日起，本基金运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照规定的征收率缴纳增值税及附加税费。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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
平安银行股份有限公司	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
浙商证券股份	739,802,645.91	53.57%	305,416,545.94	50.36%

有限公司				
------	--	--	--	--

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
浙商证券股份有限公司	—	—	1,317,018.08	100.00%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
浙商证券股份有限公司	278,200,000.00	100.00%	8,605,900,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比区间，均未发生权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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
浙商证券股份有限公司	688,978.29	59.50%	19,294.61	56.61%
关联方名称	上年度可比期间 2016年2月3日至2016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

浙商证券股份 有限公司	284,434.17	56.20%	59,483.00	77.33%
----------------	------------	--------	-----------	--------

注：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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,030,471.54	1,460,518.18
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	171,745.26	243,419.61

注：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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度对比区间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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年2月3日至2016年12 月31日
基金合同生效日(2016年2月3日)持有的基金份额	25,000,701.39	25,000,701.39
期初持有的基金份额	25,000,701.39	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	25,000,701.39	—
期末持有的基金份额	—	25,000,701.39
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	42.34%

注：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。

##### 7.4.10.4.2 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

本基金在本报告期末及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

##### 7.4.10.5 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
-------	----	---------

	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年2月3日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行活期存款	1,072,254.81	40,836.51	5,290,280.29	73,771.87
平安银行定期存款	—	—	—	84,000.00

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内与去年同比区间均未参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比区间均未发生其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

至本报告期末，本基金未持有暂时停牌的股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 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,无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### **7.4.13.2 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平安银行,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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本报告期末本基金未持有债券。

##### **7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

本报告期末本基金未持有债券。

#### **7.4.13.3 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。

##### **7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

截止本报告期末,本基金持有的资产具有较好的流动性,在样本天数为20日,变现系数为0.03的情形下,期末资产的变现天数为0.22天。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2017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	1,072,254.81	—	—	—	—	—	1,072,254.81
结算备付金	616,979.59	—	—	—	—	—	616,979.59
存出保证金	72,133.71	—	—	—	—	—	72,133.71
交易性金融资产	—	—	—	—	—	11,948,394.00	11,948,394.00
买入返售金融资产	1,900,000.00	—	—	—	—	—	1,900,000.00
应收证券清算款	—	—	—	—	—	186,328.33	186,328.33
应收利息	—	—	—	—	—	-201.26	-201.26
应收申购款	—	—	—	—	—	7,988.02	7,988.02
资产总计	3,661,368.11	—	—	—	—	12,142,509.09	15,803,877.20
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	141,800.80	141,800.80
应付赎回款	—	—	—	—	—	101,531.80	101,531.80
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	23,006.24	23,006.24
应付托管费	—	—	—	—	—	3,834.36	3,834.36
应付交易费用	—	—	—	—	—	34,081.83	34,081.83
其他负债	—	—	—	—	—	70,489.0	70,489.0

						1	1
负债总计	—	—	—	—	—	374,744.04	374,744.04
利率敏感度缺口	3,661,368.11	—	—	—	—	11,767,765.05	15,429,133.16
上年度末 2016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	5,290,280.29	—	—	—	—	—	5,290,280.29
结算备付金	2,804,443.88	—	—	—	—	—	2,804,443.88
存出保证金	104,510.66	—	—	—	—	—	104,510.66
交易性金融资产	—	—	—	—	—	49,152,205.55	49,152,205.55
应收利息	—	—	—	—	—	4,930.53	4,930.53
应收申购款	—	—	—	—	—	1,555,666.01	1,555,666.01
资产总计	8,199,234.83	—	—	—	—	50,712,802.09	58,912,036.92
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	1,408,410.84	1,408,410.84
应付赎回款	—	—	—	—	—	607,439.51	607,439.51
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	70,667.88	70,667.88
应付托管费	—	—	—	—	—	11,777.98	11,777.98
应付交易费用	—	—	—	—	—	76,920.50	76,920.50
其他负债	—	—	—	—	—	62,589.3	62,589.3

						4	4
负债总计	—	—	—	—	—	2,237,806.05	2,237,806.05
利率敏感度缺口	8,199,234.83	—	—	—	—	48,474,996.04	56,674,230.87

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

#### 7.4.13.4.2 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，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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	11,948,394.00	77.44	49,152,205.55	86.73
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
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	11,948,394.00	77.44	49,152,205.55	86.73

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为中证800指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。 2、假定中证800指数变化5%，其他市场变量均不发生变化。 3、Beta系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去100个交易日与其对应的指数数据回归加权得出。		
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(2017年12月31日)	上年度末(2016年12月31日)
	1、中证800指数上涨5%	634,855.86	2,639,803.54
	2、中证800指数下跌5%	-634,855.86	-2,639,803.54

#### 7.4.14 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。

## § 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	11,948,394.00	75.60
	其中：股票	11,948,394.00	75.60
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	1,900,000.00	12.02
	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	1,689,234.40	10.69
7	其他各项资产	266,248.80	1.68
8	合计	15,803,877.20	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	609,840.00	3.95
B	采矿业	474,720.00	3.08
C	制造业	6,867,814.00	44.51
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	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	913,480.00	5.92
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	177,560.00	1.15
J	金融业	1,390,960.00	9.02
K	房地产业	489,000.00	3.17
L	租赁和商务服务业	—	—
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	316,620.00	2.05
R	文化、体育和娱乐业	708,400.00	4.59
S	综合	—	—

	合计	11,948,394.00	77.44
--	----	---------------	-------

### 8.3 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	601333	广深铁路	164,000	913,480.00	5.92
2	600977	中国电影	46,000	708,400.00	4.59
3	000776	广发证券	42,000	700,560.00	4.54
4	601688	华泰证券	40,000	690,400.00	4.47
5	002171	楚江新材	89,000	642,580.00	4.16
6	600366	宁波韵升	36,000	630,720.00	4.09
7	002696	百洋股份	33,000	609,840.00	3.95
8	002465	海格通信	60,000	575,400.00	3.73
9	002690	美亚光电	29,000	558,830.00	3.62
10	600549	厦门钨业	19,000	489,060.00	3.17
11	603993	洛阳钼业	69,000	474,720.00	3.08
12	603111	康尼机电	35,000	472,500.00	3.06
13	600031	三一重工	51,000	462,570.00	3.00
14	601766	中国中车	38,000	460,180.00	2.98
15	002361	神剑股份	80,000	450,400.00	2.92
16	000039	中集集团	19,000	434,150.00	2.81
17	002294	信立泰	9,100	411,229.00	2.67
18	002572	索菲亚	9,500	349,600.00	2.27
19	000568	泸州老窖	5,000	330,000.00	2.14
20	300347	泰格医药	9,000	316,620.00	2.05
21	000002	万科A	10,000	310,600.00	2.01
22	300408	三环集团	15,000	302,400.00	1.96
23	300009	安科生物	11,500	298,195.00	1.93
24	002285	世联行	16,000	178,400.00	1.16
25	300036	超图软件	11,500	177,560.00	1.15

## 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	002138	顺络电子	16,390,379.34	28.92
2	600110	诺德股份	12,791,689.55	22.57
3	000776	广发证券	12,558,320.00	22.16
4	002171	楚江新材	12,182,085.67	21.49
5	600549	厦门钨业	11,620,494.25	20.50
6	600416	湘电股份	10,329,183.36	18.23
7	601601	中国太保	10,134,052.88	17.88
8	601688	华泰证券	9,867,811.59	17.41
9	300257	开山股份	9,720,134.77	17.15
10	600366	宁波韵升	9,373,159.89	16.54
11	600111	北方稀土	9,014,923.60	15.91
12	002250	联化科技	8,761,774.70	15.46
13	603993	洛阳钼业	8,698,476.00	15.35
14	002230	科大讯飞	8,342,711.13	14.72
15	002217	合力泰	8,294,147.98	14.63
16	601628	中国人寿	8,027,876.98	14.17
17	000826	启迪桑德	7,906,933.09	13.95
18	603799	华友钴业	7,743,365.07	13.66
19	002127	南极电商	7,723,353.72	13.63
20	600804	鹏博士	7,362,452.71	12.99
21	002108	沧州明珠	7,361,457.15	12.99
22	002690	美亚光电	7,349,336.52	12.97
23	600699	均胜电子	7,344,351.13	12.96
24	000063	中兴通讯	7,332,705.07	12.94
25	600089	特变电工	7,206,080.85	12.71



26	601336	新华保险	7,171,751.00	12.65
27	300424	航新科技	7,104,397.00	12.54
28	600977	中国电影	7,091,842.95	12.51
29	002281	光迅科技	6,980,459.64	12.32
30	002456	欧菲科技	6,758,926.00	11.93
31	600820	隧道股份	6,720,586.00	11.86
32	002294	信立泰	6,606,682.06	11.66
33	300244	迪安诊断	6,602,039.96	11.65
34	300332	天壕环境	6,539,282.52	11.54
35	300009	安科生物	6,193,726.34	10.93
36	600109	国金证券	6,127,236.00	10.81
37	002241	歌尔股份	6,038,613.67	10.66
38	601607	上海医药	5,974,577.97	10.54
39	300326	凯利泰	5,959,835.25	10.52
40	600999	招商证券	5,912,593.94	10.43
41	600588	用友网络	5,885,154.28	10.38
42	600373	中文传媒	5,798,114.36	10.23
43	000811	冰轮环境	5,774,493.50	10.19
44	601006	大秦铁路	5,597,177.00	9.88
45	601985	中国核电	5,503,977.00	9.71
46	002739	万达电影	5,264,407.43	9.29
47	603108	润达医疗	5,217,347.58	9.21
48	600271	航天信息	5,122,779.94	9.04
49	600038	中直股份	5,105,596.66	9.01
50	002640	跨境通	4,969,827.24	8.77
51	600500	中化国际	4,896,710.00	8.64
52	600418	江淮汽车	4,825,199.00	8.51
53	600498	烽火通信	4,821,923.00	8.51
54	002465	海格通信	4,821,503.00	8.51
55	600893	航发动力	4,773,093.00	8.42

56	002371	北方华创	4,624,096.35	8.16
57	002322	理工环科	4,554,158.30	8.04
58	002019	亿帆医药	4,466,107.26	7.88
59	600104	上汽集团	4,458,759.96	7.87
60	000783	长江证券	4,361,615.00	7.70
61	600518	康美药业	4,175,928.64	7.37
62	600068	葛洲坝	4,119,669.00	7.27
63	002589	瑞康医药	4,073,619.16	7.19
64	601111	中国国航	4,062,693.00	7.17
65	002179	中航光电	4,046,728.96	7.14
66	600879	航天电子	3,977,416.44	7.02
67	300188	美亚柏科	3,912,838.40	6.90
68	000661	长春高新	3,870,844.30	6.83
69	002366	台海核电	3,863,624.00	6.82
70	002022	科华生物	3,803,132.39	6.71
71	300078	思创医惠	3,791,568.16	6.69
72	000915	山大华特	3,769,165.49	6.65
73	601333	广深铁路	3,672,747.98	6.48
74	600155	宝硕股份	3,610,064.00	6.37
75	300334	津膜科技	3,594,633.52	6.34
76	601919	中远海控	3,578,703.00	6.31
77	002361	神剑股份	3,430,250.00	6.05
78	600837	海通证券	3,240,062.00	5.72
79	600329	中新药业	3,237,506.00	5.71
80	600990	四创电子	3,165,437.00	5.59
81	000963	华东医药	3,052,778.98	5.39
82	600406	国电南瑞	3,008,450.00	5.31
83	600705	中航资本	3,002,975.00	5.30
84	300347	泰格医药	3,001,613.57	5.30
85	601211	国泰君安	2,999,223.00	5.29

86	300059	东方财富	2,943,314.84	5.19
87	600703	三安光电	2,922,982.00	5.16
88	600172	黄河旋风	2,920,861.00	5.15
89	600547	山东黄金	2,873,726.06	5.07
90	600029	南方航空	2,846,660.00	5.02
91	600028	中国石化	2,828,600.00	4.99
92	603111	康尼机电	2,826,497.50	4.99
93	002008	大族激光	2,723,890.04	4.81
94	600511	国药股份	2,711,135.16	4.78
95	601766	中国中车	2,680,522.00	4.73
96	002340	格林美	2,654,243.00	4.68
97	002262	恩华药业	2,647,861.88	4.67
98	600420	现代制药	2,614,381.00	4.61
99	002010	传化智联	2,528,251.00	4.46
100	601009	南京银行	2,524,992.00	4.46
101	600596	新安股份	2,513,306.00	4.43
102	600240	华业资本	2,422,634.00	4.27
103	002182	云海金属	2,405,955.08	4.25
104	000630	铜陵有色	2,331,000.00	4.11
105	300236	上海新阳	2,261,264.60	3.99
106	600118	中国卫星	2,258,682.00	3.99
107	600332	白云山	2,214,781.00	3.91
108	600428	中远海特	2,170,120.00	3.83
109	300036	超图软件	2,146,627.00	3.79
110	002696	百洋股份	2,133,370.00	3.76
111	000738	航发控制	2,108,022.98	3.72
112	000002	万 科 A	2,067,107.36	3.65
113	600885	宏发股份	2,056,849.76	3.63
114	000728	国元证券	2,045,805.00	3.61
115	002142	宁波银行	1,999,500.60	3.53

116	601788	光大证券	1,932,174.37	3.41
117	002639	雪人股份	1,931,837.00	3.41
118	601901	方正证券	1,927,311.00	3.40
119	600619	海立股份	1,910,469.00	3.37
120	002206	海利得	1,888,562.50	3.33
121	601933	永辉超市	1,684,703.00	2.97
122	002285	世联行	1,657,930.19	2.93
123	600015	华夏银行	1,629,339.28	2.87
124	603866	桃李面包	1,620,767.00	2.86
125	600584	长电科技	1,583,726.00	2.79
126	002838	道恩股份	1,574,913.91	2.78
127	600771	广誉远	1,531,561.00	2.70
128	600258	首旅酒店	1,527,324.00	2.69
129	600150	中国船舶	1,472,760.00	2.60
130	600036	招商银行	1,452,400.00	2.56
131	300182	捷成股份	1,447,432.00	2.55
132	002223	鱼跃医疗	1,438,985.20	2.54
133	600622	光大嘉宝	1,437,748.86	2.54
134	601169	北京银行	1,410,124.08	2.49
135	600125	铁龙物流	1,406,273.56	2.48
136	002089	新海宜	1,406,036.00	2.48
137	002659	凯文教育	1,340,544.00	2.37
138	300145	中金环境	1,335,675.00	2.36
139	002026	山东威达	1,266,571.41	2.23
140	601800	中国交建	1,262,440.00	2.23
141	002126	银轮股份	1,260,273.00	2.22
142	601998	中信银行	1,255,513.00	2.22
143	603019	中科曙光	1,245,915.00	2.20
144	000736	中交地产	1,235,046.00	2.18
145	300088	长信科技	1,226,420.00	2.16

146	600030	中信证券	1,218,921.00	2.15
147	600267	海正药业	1,180,363.00	2.08

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。

#### 8.4.2 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	002138	顺络电子	16,440,202.44	29.01
2	600549	厦门钨业	12,986,909.72	22.92
3	600110	诺德股份	12,863,158.03	22.70
4	000776	广发证券	11,533,723.66	20.35
5	002171	楚江新材	10,984,816.30	19.38
6	601601	中国太保	10,837,132.63	19.12
7	600416	湘电股份	10,180,427.92	17.96
8	600111	北方稀土	9,844,904.26	17.37
9	002230	科大讯飞	9,620,686.41	16.98
10	601688	华泰证券	9,501,785.04	16.77
11	300257	开山股份	9,381,911.46	16.55
12	600366	宁波韵升	9,030,900.07	15.93
13	002217	合力泰	8,893,103.81	15.69
14	603993	洛阳钼业	8,695,197.80	15.34
15	601628	中国人寿	8,675,185.44	15.31
16	603799	华友钴业	8,435,040.87	14.88
17	002250	联化科技	8,350,794.20	14.73
18	000826	启迪桑德	8,170,855.27	14.42
19	000063	中兴通讯	7,964,614.60	14.05
20	002241	歌尔股份	7,942,013.12	14.01
21	601336	新华保险	7,905,589.76	13.95
22	002108	沧州明珠	7,872,858.63	13.89
23	300332	天壕环境	7,775,892.61	13.72

24	002127	南极电商	7,374,700.00	13.01
25	600089	特变电工	7,322,764.37	12.92
26	600699	均胜电子	7,242,708.00	12.78
27	600804	鹏博士	6,948,419.83	12.26
28	002281	光迅科技	6,881,577.51	12.14
29	002456	欧菲科技	6,833,605.00	12.06
30	600109	国金证券	6,817,462.00	12.03
31	600104	上汽集团	6,688,575.23	11.80
32	300424	航新科技	6,671,365.25	11.77
33	600820	隧道股份	6,616,689.00	11.67
34	002690	美亚光电	6,572,131.51	11.60
35	300244	迪安诊断	6,432,146.95	11.35
36	600999	招商证券	6,418,963.78	11.33
37	600977	中国电影	6,311,970.60	11.14
38	600500	中化国际	6,282,451.99	11.09
39	002294	信立泰	6,248,916.60	11.03
40	601006	大秦铁路	6,192,643.00	10.93
41	601985	中国核电	6,180,781.00	10.91
42	600588	用友网络	6,158,310.42	10.87
43	000811	冰轮环境	6,156,707.00	10.86
44	601607	上海医药	6,136,199.60	10.83
45	002589	瑞康医药	6,096,468.45	10.76
46	300009	安科生物	6,075,279.04	10.72
47	300326	凯利泰	5,985,196.67	10.56
48	600373	中文传媒	5,505,464.00	9.71
49	600893	航发动力	5,334,302.72	9.41
50	002739	万达电影	5,166,279.87	9.12
51	600038	中直股份	5,108,162.50	9.01
52	603108	润达医疗	4,972,680.92	8.77
53	002640	跨境通	4,942,106.62	8.72

54	600518	康美药业	4,786,710.04	8.45
55	002322	理工环科	4,779,171.24	8.43
56	600271	航天信息	4,680,488.01	8.26
57	600418	江淮汽车	4,673,861.55	8.25
58	600498	烽火通信	4,616,855.00	8.15
59	600406	国电南瑞	4,524,028.00	7.98
60	002371	北方华创	4,289,027.76	7.57
61	600068	葛洲坝	4,274,527.45	7.54
62	601111	中国国航	4,241,128.41	7.48
63	000783	长江证券	4,204,291.00	7.42
64	002179	中航光电	4,032,094.50	7.11
65	300188	美亚柏科	3,971,871.30	7.01
66	002019	亿帆医药	3,966,074.00	7.00
67	000915	山大华特	3,940,738.68	6.95
68	000661	长春高新	3,934,621.10	6.94
69	600879	航天电子	3,889,407.00	6.86
70	002465	海格通信	3,877,634.76	6.84
71	300078	思创医惠	3,853,126.55	6.80
72	600420	现代制药	3,810,538.54	6.72
73	002366	台海核电	3,798,711.12	6.70
74	600837	海通证券	3,776,349.22	6.66
75	601211	国泰君安	3,674,881.00	6.48
76	002022	科华生物	3,670,184.49	6.48
77	600885	宏发股份	3,636,225.37	6.42
78	601919	中远海控	3,586,957.00	6.33
79	600029	南方航空	3,579,288.19	6.32
80	601800	中国交建	3,562,500.00	6.29
81	600155	宝硕股份	3,511,303.00	6.20
82	300334	津膜科技	3,477,490.53	6.14
83	600547	山东黄金	3,391,758.00	5.98

84	600028	中国石化	3,311,634.00	5.84
85	600990	四创电子	3,184,514.00	5.62
86	000963	华东医药	3,129,386.33	5.52
87	002182	云海金属	3,082,768.98	5.44
88	300059	东方财富	3,063,595.80	5.41
89	600329	中新药业	3,051,463.45	5.38
90	600705	中航资本	3,016,220.00	5.32
91	600172	黄河旋风	2,972,717.00	5.25
92	002340	格林美	2,860,350.00	5.05
93	600703	三安光电	2,840,679.00	5.01
94	002361	神剑股份	2,812,455.00	4.96
95	601333	广深铁路	2,805,388.00	4.95
96	600511	国药股份	2,756,648.86	4.86
97	601766	中国中车	2,699,877.00	4.76
98	002008	大族激光	2,677,960.00	4.73
99	002262	恩华药业	2,671,735.66	4.71
100	300347	泰格医药	2,627,365.33	4.64
101	600150	中国船舶	2,627,211.00	4.64
102	601009	南京银行	2,562,642.00	4.52
103	300088	长信科技	2,535,240.78	4.47
104	601788	光大证券	2,519,787.24	4.45
105	600596	新安股份	2,409,267.00	4.25
106	601901	方正证券	2,408,610.00	4.25
107	603111	康尼机电	2,391,607.50	4.22
108	600332	白云山	2,361,552.00	4.17
109	000630	铜陵有色	2,282,400.00	4.03
110	002026	山东威达	2,276,930.39	4.02
111	600240	华业资本	2,264,557.00	4.00
112	600428	中远海特	2,232,193.00	3.94
113	600036	招商银行	2,226,455.80	3.93



114	002010	传化智联	2,209,537.99	3.90
115	600118	中国卫星	2,160,239.00	3.81
116	300236	上海新阳	2,104,592.95	3.71
117	002142	宁波银行	2,018,932.20	3.56
118	600619	海立股份	1,981,786.00	3.50
119	601169	北京银行	1,952,255.79	3.44
120	601933	永辉超市	1,922,343.00	3.39
121	002639	雪人股份	1,921,914.00	3.39
122	000738	航发控制	1,889,197.72	3.33
123	300036	超图软件	1,882,264.10	3.32
124	002206	海利得	1,875,994.50	3.31
125	600259	广晟有色	1,846,378.00	3.26
126	601998	中信银行	1,803,521.00	3.18
127	600771	广誉远	1,747,055.82	3.08
128	600030	中信证券	1,740,910.00	3.07
129	000728	国元证券	1,718,644.00	3.03
130	000002	万科A	1,695,026.00	2.99
131	600258	首旅酒店	1,640,210.01	2.89
132	600015	华夏银行	1,587,092.00	2.80
133	600584	长电科技	1,544,585.00	2.73
134	603866	桃李面包	1,505,584.75	2.66
135	002223	鱼跃医疗	1,481,777.00	2.61
136	002696	百洋股份	1,479,112.00	2.61
137	300182	捷成股份	1,470,712.42	2.60
138	002838	道恩股份	1,457,043.11	2.57
139	002285	世联行	1,431,425.00	2.53
140	002089	新海宜	1,422,709.24	2.51
141	600622	光大嘉宝	1,372,249.00	2.42
142	300145	中金环境	1,347,209.00	2.38
143	002126	银轮股份	1,313,741.00	2.32

144	002659	凯文教育	1,310,756.00	2.31
145	600267	海正药业	1,276,691.00	2.25
146	603019	中科曙光	1,247,807.00	2.20
147	601857	中国石油	1,216,041.00	2.15
148	600125	铁龙物流	1,211,458.00	2.14
149	601390	中国中铁	1,205,081.38	2.13
150	000736	中交地产	1,165,301.00	2.06
151	600887	伊利股份	1,149,541.00	2.03

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。

### 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	670,967,763.90
卖出股票的收入（成交）总额	711,974,129.90

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。

### 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序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。

### 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

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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

本基金未参与股指期货交易。

### 8.10.2 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。

### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 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	72,133.71
2	应收证券清算款	186,328.33
3	应收股利	—
4	应收利息	-201.26
5	应收申购款	7,988.02
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	266,248.80

#### 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债。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中，不存在流通受限情况的股票。

### 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
256	60,482.54	—	—	15,483,529.61	100.00 %

### 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	545,550.69	3.52%

### 9.3 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 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	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年2月3日)基金份额总额	242,073,014.91
--------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	59,053,131.99
本报告期基金总申购份额	86,025,638.63
减：本报告期基金总赎回份额	129,595,241.01
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	15,483,529.61

## § 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：2017年11月,合规风控总监由高玮女士变更为方斌先生。2017年12月，增聘马斌博为浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效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。

### 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	
长江证券	1	59,385,086.89	4.30%	43,428.31	3.75%	
国泰君安	1	35,822,584.92	2.59%	26,197.11	2.26%	
华创证券	1	179,422,711.08	12.99%	131,210.19	11.33%	
申万宏源	1	251,469,100.67	18.21%	183,899.75	15.88%	
兴业证券	1	115,132,562.02	8.34%	84,196.46	7.27%	
浙商证券	2	739,802,645.91	53.57%	688,978.29	59.50%	
东方证券	1	—	—	—	—	
国金证券	1	—	—	—	—	
中泰证券	1	—	—	—	—	
中信建投	1	—	—	—	—	

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交易单元进行交易。截至报告期末，本公司已在深圳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。报告期内，我司通过一家证券公司深圳交易所交易单元买卖证券的年交易佣金均未超过当年所有基金在深圳交易所交易单元买卖证券交易佣金30%。本报告期内，交易单元无变更。

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
长江证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	278,200,000.00	100.00%	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—

### 11.8 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	关于浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金暂停申购业务的公告	公司官网、证券时报	2017-01-09
2	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-01-14
3	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加浙商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-01-14
4	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-01-14

5	浙江浙商证券资产管理有限公司 关于参加上海汇付金融有限公司 申购费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-01-14
6	浙江浙商证券资产管理有限公司 关于参加大泰金石投资管理有限 公司申购费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-01-14
7	浙江浙商证券资产管理有限公司 关于参加东吴证券股份有限公司 申购费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-01-14
8	浙商汇金转型升级灵活配置混合 型证券投资基金2016年第4季度 报告	公司官网、证券时报	2017-01-21
9	关于增加利得基金为浙江浙商证 券资产管理有限公司旗下开放式 基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-01-23
10	关于增加华阳众惠为浙江浙商证 券资产管理有限公司旗下开放式 基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-02-10
11	浙商汇金转型升级灵活配置混合 型证券投资基金恢复申购业务的 公告	公司官网、证券时报	2017-02-14
12	关于增加平安证券为浙江浙商证 券资产管理有限公司旗下开放式 基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-02-27
13	浙江浙商证券资产管理有限公司 关于调整旗下部分基金在蚂蚁 （杭州）基金销售有限公司最低 申购金额、最低赎回份额及最低 保留份额的公告	公司官网、证券时报	2017-03-10
14	浙商汇金转型升级灵活配置混合 型证券投资基金招募说明书（更 新）摘要（2017年第1号）	公司官网、证券时报	2017-03-21
15	浙商汇金转型升级灵活配置混合	公司官网	2017-03-21



	型证券投资基金招募说明书（更新）（2017年第1号）		
16	浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要	公司官网、证券时报	2017-03-31
17	浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告	公司官网	2017-03-31
18	浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告	公司官网、证券时报	2017-04-21
19	浙江浙商证券资产管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-05-02
20	浙江浙商证券资产管理有限公司关于办公地址变更的公告	公司官网、证券时报	2017-05-02
21	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值办法的公告	公司官网、证券时报	2017-06-01
22	关于增加国金证券为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下开放式基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-06-19
23	浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金2017年第2季度报告	公司官网、证券时报	2017-07-21
24	浙江浙商证券资产管理有限公司关于直销柜台办公地址及联系方式变更的公告	公司官网、证券时报	2017-08-03
25	关于增加朝阳财富为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下公募基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-08-23
26	浙江浙商证券资产管理有限公司更正公告	公司官网、证券时报	2017-08-28

27	浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告	公司官网	2017-08-29
28	浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告摘要	公司官网、证券时报	2017-08-29
29	浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2017年第2号）	公司官网	2017-09-15
30	浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2017年第2号）	公司官网、证券时报	2017-09-15
31	浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金2017年第3季度报告	公司官网、证券时报	2017-10-26
32	关于增加泰诚财富为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下开放式基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-11-16
33	关于增加云湾投资为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下公募基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-12-05
34	关于增加苏宁基金为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下公募基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-12-06
35	关于增加联泰资管为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下公募基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-12-08
36	关于增加盈米财富为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下开放式基金销售机构的公告	公司官网、证券时报	2017-12-12
37	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加泰诚基金销售（大连）有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-12-14

38	关于浙江浙商证券资产管理有限公司旗下产品实施增值税政策的公告	公司官网、证券时报	2017-12-30
----	--------------------------------	-----------	------------

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日至2017年1月9日及2017年5月22日至2017年7月7日	25000701.39	0	25000701.39	0	—
个人	1	2017年1月9日至2017年5月22日		36007201.65	36007201.65	0	—
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形，在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，存在流动性风险。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

### **13.2 存放地点**

基金管理人住所及托管人住所。

### **13.3 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](http://www.stocke.com.cn)。

浙江浙商证券资产管理有限公司  
二〇一八年三月三十日