
浙商汇金转型成长混合型证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经过全部董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

浙江浙商证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§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	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	11
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	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52

§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
11.1 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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金转型成长混合型证券投资基金
基金简称	浙商汇金转型成长
基金主代码	000935
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月30日
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	166,136,909.07份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	浙江浙商证券资产管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌
	联系电话	0571-87901630
	电子邮箱	fangbin@stocke.com.cn
客户服务电话	95345	95566
传真	0571-87902581	010-66594942
注册地址	杭州市下城区天水巷25号	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	310020	100818
法定代表人	李雪峰	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.stocke.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	浙江浙商证券资产管理有限公司	杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼
会计师事务所	北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区裕民路18号北环中心22层

§ 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（2018年01月01日- 2018年06月30日）
本期已实现收益	-7,259,811.32
本期利润	-8,035,158.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0459
本期加权平均净值利润率	-6.24%
本期基金份额净值增长率	-6.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年06月30日）
期末可供分配利润	-48,828,346.09
期末可供分配基金份额利润	-0.2939
期末基金资产净值	117,308,562.98
期末基金份额净值	0.706
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2018年06月30日）
基金份额累计净值增长率	-24.31%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-3.95%	0.80%	-5.14%	0.89%	1.19%	-0.09%
过去三个月	-3.16%	0.97%	-6.50%	0.79%	3.34%	0.18%

过去六个月	-6.37%	0.99%	-8.24%	0.80%	1.87%	0.19%
过去一年	-2.08%	0.95%	-2.43%	0.66%	0.35%	0.29%
过去三年	-53.37%	1.48%	-13.99%	1.04%	-39.38%	0.44%
自基金合同生效起至今	-24.31%	1.66%	3.95%	1.13%	-28.26%	0.53%

基准指数的构建原则如下：

- 1、沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。
- 2、中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。
- 3、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70%、30%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

浙商汇金转型成长混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§ 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下发的《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）批准成立，2014年8月19日又经中国证券监督管理委员会下发的《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）批准可以从事公募基金管理业务。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2018年6月30日，本基金管理人管理浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、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、浙商汇金鼎盈事件驱动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； 浙商汇金转型升级灵活配置混合型基金基金经理	2016-03-10	-	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混合型基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型基金基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
马斌博	本基金基金经理；	2018-04-19	-	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

	浙商汇金 转型升级 灵活配置 混合型基 金及浙商 汇金鼎盈 事件驱动 灵活配置 混合型基 金的基金 经理				研究员；浙江浙商证券资产管理有限公司研究部研究员、公募基金部基金经理助理；现任浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型基金、浙商汇金转型成长混合型基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型基金的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
--	------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：上述表格内基金经理的任职日期、离职日期均指公司作出决定并公告披露之日。证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，浙江浙商证券资产管理有限公司作为浙商汇金转型成长混合型证券投资基金的管理人，严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在经历短暂的顺周期上涨后，A股市场大环境于2018年2月前后发生剧烈变化，其最大的宏观背景是在经历2016年至2017年全球共振复苏后的分化，后续中美贸易摩擦持续发酵和升级，更为复苏尾声的经济体雪上加霜；基于此宏观背景，全球同步复苏、经济向上带来企业利润和资产负债表的修复边际递减，银行、地产产业链以及其他顺经济周期品种可能面临压力，同时与经济周期并不完全同步的新兴成长板块在经历两年熊市后，出现边际改善迹象，基于大的资产类别的比较，策略上本产品上半年把投资重点放在了医药、TMT、新型消费等新兴成长方向。

2018年5月至6月，随着中美贸易摩擦升级，同时叠加国内宏观去杠杆带来的信用风险爆发，经济下行压力持续攀升，金融风险因素逐步累积，短期内难有向上力量扭转市场悲观预期，策略上我们进一步降低了持仓仓位至低配，以防范风险为重要策略考量。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为0.706元，本报告期内，基金份额净值增长率为-6.37%，同期业绩比较基准收益率为-8.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年下半年，从驱动经济的三驾马车看，投资、消费和净出口似乎都出现了一些问题。从投资看，基建受制于地方财政、房地产由于棚改货币化的收紧会先看到销售的回落再看到投资增速的下行；从消费看，如果2016-2017年消费的繁荣很大程度上来自于三四线城市棚改货币化安置带来的财富效应的话，那么棚改货币化退出对居民消费的实质连锁影响将是不容小觑的；出口方面，中美贸易摩擦自然是主要的影响变量，如果后面中美互征额度继续增加，净出口将成为经济的拖累项。目前来看还看不到太多积极地因素可以对经济运行比较安心。基于上述分析，2018年下半年A股市场大势不宜过分乐观，从具体行业方向看，顺经济周期的银行、地产产业链以及部分消费品仍难取得超额收益，对于新兴产业而言，政策仍是重要的中长期变量，医药、计算机、电子等行业仍是中期超额收益的方向，但考虑到细分产业景气度差异大、上市公司质地参差不齐，应以未来两个季度的季度报告为主要线索，寻找潜在景气度超预期的细分领域。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币

风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

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，本基金未发生《公开募集证券投资基金运行管理办法》的第四十一条所述情形。

§ 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在浙商汇金转型成长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金转型成长混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	16,730,113.59	664,907.71
结算备付金		1,280,282.14	3,700,056.46
存出保证金		116,006.79	77,837.67
交易性金融资产	6.4.7.2	46,236,232.14	131,913,110.49
其中：股票投资		46,236,232.14	122,855,716.99
基金投资		-	-
债券投资		-	9,057,393.50
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	23,200,000.00	9,000,000.00
应收证券清算款		34,671,223.42	538,926.49
应收利息	6.4.7.5	15,961.14	197,956.47
应收股利		-	-
应收申购款		1,997.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		122,251,816.22	146,092,795.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
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		3,515,396.25	-
应付赎回款		174,606.21	521,111.83
应付管理人报酬		148,636.46	188,252.26
应付托管费		24,772.74	31,375.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	994,393.77	330,107.54
应交税费		1,139.10	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,308.71	210,178.07
负债合计		4,943,253.24	1,281,025.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	166,136,909.07	192,152,162.92
未分配利润	6.4.7.1 0	-48,828,346.09	-47,340,392.71
所有者权益合计		117,308,562.98	144,811,770.21
负债和所有者权益总计		122,251,816.22	146,092,795.29

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.706元，基金份额总额166,136,909.07份。

6.2 利润表

会计主体：浙商汇金转型成长混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		-3,804,755.79	9,214,559.42
1. 利息收入		366,447.04	90,286.69
其中：存款利息收入	6.4.7.1	139,679.60	55,335.63

	1		
债券利息收入		84,976.81	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		141,790.63	34,951.06
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,402,382.67	-5,103,100.87
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-3,817,361.36	-5,642,465.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	5,115.08	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.1 3.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	409,863.61	539,365.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-775,347.01	14,199,899.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	6,526.85	27,474.37
减：二、费用		4,230,402.54	3,560,703.70
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	955,505.78	1,273,118.17
2. 托管费	6.4.10. 2.2	159,250.98	212,186.35

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,021,810.18	1,964,495.61
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		510.44	-
7. 其他费用	6.4.7.19	93,325.16	110,903.57
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-8,035,158.33	5,653,855.72
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-8,035,158.33	5,653,855.72

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 浙商汇金转型成长混合型证券投资基金

本报告期: 2018年01月01日至2018年06月30日

单位: 人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年06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)	192,152,162.92	-47,340,392.71	144,811,770.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,035,158.33	-8,035,158.33
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)	-26,015,253.85	6,547,204.95	-19,468,048.90
其中: 1. 基金申购款	1,794,214.54	-487,530.67	1,306,683.87
2. 基金赎回	-27,809,468.39	7,034,735.62	-20,774,732.77

款			
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）	166,136,909.07	-48,828,346.09	117,308,562.98
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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）	252,080,666.13	-76,212,775.91	175,867,890.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,653,855.72	5,653,855.72
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）	-26,847,874.42	7,635,822.06	-19,212,052.36
其中：1. 基金申购款	3,627,361.52	-1,044,643.25	2,582,718.27
2. 基金赎回款	-30,475,235.94	8,680,465.31	-21,794,770.63
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）	225,232,791.71	-62,923,098.13	162,309,693.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

李雪峰

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浙商汇金转型成长混合型证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)(证监许可[2014]1271号)《关于准予浙商汇金转型成长混合型证券投资基金注册的批复》批准,由浙江浙商证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金基金合同》向社会公开发行人募集。《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金基金合同》于2014年12月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,568,594,317.69份基金份额,相关募集业经北京兴华会计师事务所[2014]京会兴浙分验字第68000046号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。基金管理人为浙江浙商证券资产管理有限公司,注册登记机构为浙江浙商证券资产管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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

本基金本报告期内无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140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[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，

持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018年06月30日
活期存款	16,730,113.59
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	16,730,113.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	45,115,980.34	46,236,232.14	1,120,251.80
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	45,115,980.34	46,236,232.14	1,120,251.80

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末，未持有任何衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	23,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	23,200,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应收活期存款利息	13,279.77
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	575.20
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,053.97
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	52.20
合计	15,961.14

6.4.7.6 其他资产

本基金在本报告期末，无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	994,393.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	994,393.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6.15
预提费用	84,302.56
合计	84,308.71

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	192,152,162.92	192,152,162.92
本期申购	1,794,214.54	1,794,214.54
本期赎回（以“-”号填列）	-27,809,468.39	-27,809,468.39
本期末	166,136,909.07	166,136,909.07

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	-10,516,881.58	-36,823,511.13	-47,340,392.71
本期利润	-7,259,811.32	-775,347.01	-8,035,158.33
本期基金份额交易产生的变动数	1,701,131.84	4,846,073.11	6,547,204.95
其中：基金申购款	-143,205.43	-344,325.24	-487,530.67
基金赎回款	1,844,337.27	5,190,398.35	7,034,735.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,075,561.06	-32,752,785.03	-48,828,346.09

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	119,843.82
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	19,065.76
其他	770.02
合计	139,679.60

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出股票成交总额	1,089,915,574.53
减：卖出股票成本总额	1,093,732,935.89
买卖股票差价收入	-3,817,361.36

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

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30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	5,115.08
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	5,115.08

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,353,848.16
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,064,084.92
减：应收利息总额	284,648.16
买卖债券差价收入	5,115.08

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未进行资产支持证券投资。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	409,863.61
基金投资产生的股利收益	-

合计	409,863.61
----	------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-775,347.01
——股票投资	-782,038.43
——债券投资	6,691.42
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-775,347.01

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	6,526.85
合计	6,526.85

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	3,021,810.18

银行间市场交易费用	-
合计	3,021,810.18

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	9,022.60
合计	93,325.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截止本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浙商证券股份有限公司	基金管理人的母公司、本基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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 股份有限 公司	1,019,500,501.73	48.38%	768,466,114.18	56.44%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未发生权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
浙商证券 股份有限 公司	1,498,200.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交	成交金额	占当期 债券回 购成交

		总额的 比例		总额的 比例
浙商证券 股份有限 公司	439,300,000.00	100.00%	213,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2018年01月01日至2018年06月30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	949,462.51	54.41%	82,368.81	8.28%
关联方名 称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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	715,672.41	62.26%	174,682.06	24.98%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格，上海证券市场只能使用母公司浙商证券席位进行交易。

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 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	955,505.78	1,273,118.17
其中：支付销售机构的客户维护费	476,328.82	634,650.70

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	159,250.98	212,186.35

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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。

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

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06 月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06 月30日
基金合同生效日（2014年12月30日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,096,356.28	8,096,356.28
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	8,096,356.28	8,096,356.28
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.87%	3.59%

注：1、上表列示的报告期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，列示的报告期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、本报告期内，基金管理人运用固有资金投资本基金费率与其他投资者执行的费率一致，基金管理人赎回本基金份额的行为遵从《基金管理公司固有资金运用管理暂行规定》的相关规定。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本本基金在本报告期内及上年度可比期间均未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间

称	2018年01月01日至2018年06月30日		2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	16,730,113.59	119,843.82	10,701,253.77	42,860.44

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

6.4.11 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。

6.4.12 期末（2018年06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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
603939	益丰药房	2018-04-17	重大资产重组	53.06	2018-07-16	65.69	42,400	2,448,662.00	2,249,744.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险较小。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2018年06 月30日	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	
银行存款	16,730, 113.59	-	-	-	-	16,730,113.59
结算备付 金	1,280,2 82.14	-	-	-	-	1,280,282.14
存出保证 金	116,00 6.79	-	-	-	-	116,006.79
买入返售 金融资产	23,200, 000.00	-	-	-	-	23,200,000.00
资产总计	41,326, 402.52	-	-	-	-	41,326,402.52
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净	41,326,	-	-	-	-	41,326,402.5

额	402.52					2
上年度末 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	合计
资产	-	-	-	-	-	
银行存款	664,90 7.71	-	-	-	-	664,907.71
结算备付 金	3,700,0 56.46	-	-	-	-	3,700,056.46
存出保证 金	77,837. 67	-	-	-	-	77,837.67
买入返售 金融资产	9,000,0 00.00	-	-	-	-	9,000,000.00
资产总计	13,442, 801.84	-	-	-	-	13,442,801.8 4
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净 额	13,442, 801.84	-	-	-	-	13,442,801.8 4

6.4.13.3.2 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，本基金未持有流通受限资产。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年 06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	16,730,113.59	-	-	-	-	-	16,730,113.59
结算备付金	1,280,282.14	-	-	-	-	-	1,280,282.14
存出保证金	116,006.79	-	-	-	-	-	116,006.79
交易性金融资产	-	-	-	-	-	46,236,232.14	46,236,232.14
买入返售金融资产	23,200,000.00	-	-	-	-	-	23,200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	34,671,223.42	34,671,223.42
应收利息	-	-	-	-	-	15,961.14	15,961.14
应收申购款	-	-	-	-	-	1,997.00	1,997.00
资产总计	41,326,402.52	-	-	-	-	80,925,413.70	122,251,816.22
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,515,396.25	3,515,396.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	174,606.21	174,606.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	148,636.46	148,636.46
应付托管费	-	-	-	-	-	24,772.74	24,772.74
应付交易费用	-	-	-	-	-	994,393.77	994,393.77
应交税费	-	-	-	-	-	1,139.10	1,139.10
其他负债	-	-	-	-	-	84,308.71	84,308.71
负债总计	-	-	-	-	-	4,943,253.24	4,943,253.24

利率敏感度缺口	41,326,402.52	-	-	-	-	75,982,160.46	117,308,562.98
上年度末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	664,907.71	-	-	-	-	-	664,907.71
结算备付金	3,700,056.46	-	-	-	-	-	3,700,056.46
存出保证金	77,837.67	-	-	-	-	-	77,837.67
交易性金融资产	-	-	9,057,393.50	-	-	122,855,716.99	131,913,110.49
买入返售金融资产	9,000,000.00	-	-	-	-	-	9,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	538,926.49	538,926.49
应收利息	-	-	-	-	-	197,956.47	197,956.47
资产总计	13,442,801.84	-	9,057,393.50	-	-	123,592,599.95	146,092,795.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	521,111.83	521,111.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	188,252.26	188,252.26
应付托管费	-	-	-	-	-	31,375.38	31,375.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	330,107.54	330,107.54
其他负债	-	-	-	-	-	210,178.07	210,178.07
负债总计	-	-	-	-	-	1,281,025.08	1,281,025.08
利率敏感度缺口	13,442,801.84	-	9,057,393.50	-	-	122,311,574.87	144,811,770.21

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额		
假设	2、假定除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
假设	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动		
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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	1、市场利率下降25个基点	-	211,865.00
	2、市场利率上升25个基点	-	-211,865.00

本报告期末本基金未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险,主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除 市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险,主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响,由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017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	46,236,232.14	39.41	122,855,716.99	84.84
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	9,057,393.50	6.25
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	46,236,232.14	39.41	131,913,110.49	91.09

6.4.13.4.3.2 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沪深300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、假定沪深300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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	1. 沪深300指数上涨5%	2,671,183.36	5,275,361.13
	2. 沪深300指数下跌5%	-2,671,183.36	-5,275,361.13

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	置信区间为95%		
	观察期为180天		
	风险价值		
分析	风险价值	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日

	风险价值	-2,140,562.57	-1,910,013.05
	合计	-2,140,562.57	-1,910,013.05

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	46,236,232.14	37.82
	其中：股票	46,236,232.14	37.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	23,200,000.00	18.98
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,010,395.73	14.73
8	其他各项资产	34,805,188.35	28.47
9	合计	122,251,816.22	100.00

7.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	3,441,108.33	2.93
C	制造业	23,470,909.71	20.01
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	4,721,524.00	4.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,791,597.10	2.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,994,127.00	4.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	3,510,726.00	2.99
R	文化、体育和娱乐业	3,306,240.00	2.82
S	综合	-	-
	合计	46,236,232.14	39.41

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	52,400	3,982,400.00	3.39
2	600028	中国石化	530,217	3,441,108.33	2.93
3	000681	视觉中国	115,200	3,306,240.00	2.82
4	002120	韵达股份	52,622	2,791,597.10	2.38
5	000661	长春高新	11,400	2,595,780.00	2.21
6	600570	恒生电子	47,300	2,504,535.00	2.13
7	000977	浪潮信息	104,600	2,494,710.00	2.13

8	300170	汉得信息	153,300	2,489,592.00	2.12
9	603019	中科曙光	54,100	2,481,567.00	2.12
10	002419	天虹股份	169,300	2,471,780.00	2.11
11	600867	通化东宝	101,443	2,431,588.71	2.07
12	603658	安图生物	29,400	2,424,324.00	2.07
13	603799	华友钴业	24,400	2,378,268.00	2.03
14	600809	山西汾酒	37,800	2,377,242.00	2.03
15	600884	杉杉股份	104,300	2,305,030.00	1.96
16	603939	益丰药房	42,400	2,249,744.00	1.92
17	300015	爱尔眼科	54,500	1,759,805.00	1.50
18	300347	泰格医药	28,300	1,750,921.00	1.49

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	001979	招商蛇口	26,469,986.93	18.28
2	600029	南方航空	19,569,135.49	13.51
3	000333	美的集团	18,285,199.00	12.63
4	000002	万科A	18,279,438.52	12.62
5	601155	新城控股	17,607,525.99	12.16
6	600570	恒生电子	17,459,375.58	12.06
7	002202	金风科技	16,999,144.12	11.74
8	600887	伊利股份	15,801,607.80	10.91
9	300618	寒锐钴业	15,039,763.00	10.39
10	601288	农业银行	14,810,352.00	10.23
11	601398	工商银行	14,710,775.12	10.16
12	000001	平安银行	14,322,673.91	9.89
13	600703	三安光电	13,809,261.18	9.54
14	600028	中国石化	13,725,944.70	9.48

15	002465	海格通信	12,666,269.00	8.75
16	002714	牧原股份	12,649,093.30	8.73
17	000681	视觉中国	12,264,809.00	8.47
18	000776	广发证券	11,928,477.01	8.24
19	300170	汉得信息	11,653,216.08	8.05
20	002466	天齐锂业	11,534,893.56	7.97
21	601318	中国平安	11,136,828.00	7.69
22	603799	华友钴业	11,101,756.82	7.67
23	600030	中信证券	10,744,020.38	7.42
24	300188	美亚柏科	10,743,471.15	7.42
25	600438	通威股份	10,640,338.36	7.35
26	000661	长春高新	10,503,966.40	7.25
27	601009	南京银行	10,377,150.52	7.17
28	601857	中国石油	10,347,988.00	7.15
29	601939	建设银行	9,824,241.00	6.78
30	000977	浪潮信息	9,782,147.90	6.76
31	600258	首旅酒店	9,462,343.18	6.53
32	600196	复星医药	9,321,519.30	6.44
33	300036	超图软件	9,240,016.00	6.38
34	600031	三一重工	9,085,553.00	6.27
35	600498	烽火通信	8,845,388.56	6.11
36	603108	润达医疗	8,838,623.34	6.10
37	300253	卫宁健康	8,822,122.86	6.09
38	002672	东江环保	8,706,209.08	6.01
39	000066	中国长城	8,695,603.07	6.00
40	300098	高新兴	8,343,180.00	5.76
41	600600	青岛啤酒	8,256,744.73	5.70
42	600884	杉杉股份	8,199,948.48	5.66
43	601688	华泰证券	8,160,097.39	5.63
44	600340	华夏幸福	8,092,377.00	5.59
45	600763	通策医疗	8,026,775.00	5.54

46	002531	天顺风能	7,945,761.18	5.49
47	603658	安图生物	7,870,503.12	5.43
48	002410	广联达	7,589,184.20	5.24
49	002294	信立泰	7,579,930.72	5.23
50	002680	长生生物	7,497,795.68	5.18
51	603019	中科曙光	7,419,517.00	5.12
52	002493	荣盛石化	7,401,781.00	5.11
53	603993	洛阳钼业	7,264,833.00	5.02
54	600138	中青旅	7,243,923.63	5.00
55	002419	天虹股份	7,243,218.00	5.00
56	000963	华东医药	7,196,319.00	4.97
57	002460	赣锋锂业	7,004,175.94	4.84
58	002008	大族激光	6,975,390.32	4.82
59	002405	四维图新	6,866,113.00	4.74
60	000425	徐工机械	6,855,598.00	4.73
61	000858	五粮液	6,800,132.00	4.70
62	601601	中国太保	6,789,563.70	4.69
63	002440	闰土股份	6,737,431.40	4.65
64	601088	中国神华	6,495,411.56	4.49
65	300357	我武生物	6,301,882.80	4.35
66	002507	涪陵榨菜	6,213,861.00	4.29
67	300529	健帆生物	6,196,688.00	4.28
68	600466	蓝光发展	6,136,616.00	4.24
69	600588	用友网络	5,776,727.60	3.99
70	603708	家家悦	5,662,030.60	3.91
71	300212	易华录	5,599,405.00	3.87
72	002236	大华股份	5,570,312.03	3.85
73	300601	康泰生物	5,518,437.04	3.81
74	600036	招商银行	5,418,857.00	3.74
75	000895	双汇发展	5,381,534.92	3.72
76	300136	信维通信	5,207,010.90	3.60

77	002185	华天科技	5,149,627.00	3.56
78	300059	东方财富	5,137,238.35	3.55
79	600436	片仔癀	5,094,929.00	3.52
80	601877	正泰电器	5,057,303.78	3.49
81	603883	老百姓	5,014,612.00	3.46
82	600521	华海药业	5,001,448.44	3.45
83	300166	东方国信	4,973,736.04	3.43
84	600867	通化东宝	4,933,163.00	3.41
85	600585	海螺水泥	4,909,501.74	3.39
86	002262	恩华药业	4,906,797.00	3.39
87	601818	光大银行	4,616,798.00	3.19
88	601668	中国建筑	4,607,848.00	3.18
89	002340	格林美	4,395,805.64	3.04
90	600583	海油工程	4,389,584.05	3.03
91	300168	万达信息	4,375,720.00	3.02
92	000039	中集集团	4,362,014.98	3.01
93	002341	新纶科技	4,352,471.00	3.01
94	000725	京东方 A	4,307,400.00	2.97
95	601336	新华保险	4,236,648.00	2.93
96	300015	爱尔眼科	4,222,171.13	2.92
97	600549	厦门钨业	4,188,004.00	2.89
98	002640	跨境通	3,866,255.00	2.67
99	300251	光线传媒	3,864,744.20	2.67
100	300122	智飞生物	3,757,380.00	2.59
101	002007	华兰生物	3,748,169.00	2.59
102	002368	太极股份	3,725,220.00	2.57
103	600584	长电科技	3,712,550.00	2.56
104	601607	上海医药	3,687,424.41	2.55
105	600115	东方航空	3,640,404.18	2.51
106	601933	永辉超市	3,629,230.00	2.51
107	002690	美亚光电	3,577,500.84	2.47

108	002195	二三四五	3,277,630.00	2.26
109	300033	同花顺	3,220,576.00	2.22
110	603589	口子窖	3,205,749.00	2.21
111	002120	韵达股份	3,204,790.00	2.21
112	002138	顺络电子	3,151,527.00	2.18
113	300070	碧水源	3,133,514.00	2.16
114	002310	东方园林	3,124,772.00	2.16
115	601800	中国交建	3,038,365.04	2.10
116	000513	丽珠集团	2,986,034.00	2.06
117	601766	中国中车	2,973,801.00	2.05
118	601222	林洋能源	2,968,825.00	2.05
119	002415	海康威视	2,948,038.60	2.04
120	600373	中文传媒	2,914,050.00	2.01
121	601111	中国国航	2,912,569.93	2.01
122	601006	大秦铁路	2,909,831.00	2.01

注：1、表中买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、表中“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	001979	招商蛇口	26,222,321.51	18.11
2	000002	万科A	20,787,312.35	14.35
3	600029	南方航空	20,324,717.00	14.04
4	601155	新城控股	18,633,454.11	12.87
5	000776	广发证券	18,163,627.00	12.54
6	002465	海格通信	17,956,406.38	12.40
7	000333	美的集团	17,352,917.72	11.98
8	002202	金风科技	16,109,912.17	11.12

9	300618	寒锐钴业	15,446,219.85	10.67
10	600570	恒生电子	15,085,525.36	10.42
11	600887	伊利股份	15,018,659.91	10.37
12	601398	工商银行	14,449,166.58	9.98
13	601688	华泰证券	14,314,528.00	9.88
14	601288	农业银行	13,904,207.70	9.60
15	000001	平安银行	13,813,418.41	9.54
16	600031	三一重工	13,401,541.87	9.25
17	600703	三安光电	13,106,703.31	9.05
18	002714	牧原股份	12,466,076.94	8.61
19	600258	首旅酒店	12,434,056.62	8.59
20	603993	洛阳钼业	12,015,111.00	8.30
21	300036	超图软件	11,757,401.31	8.12
22	601318	中国平安	11,428,384.00	7.89
23	002466	天齐锂业	11,366,702.79	7.85
24	600030	中信证券	10,730,257.00	7.41
25	601857	中国石油	10,581,272.61	7.31
26	300188	美亚柏科	10,575,199.60	7.30
27	600438	通威股份	10,508,782.27	7.26
28	600028	中国石化	10,492,725.00	7.25
29	002294	信立泰	10,489,619.93	7.24
30	300253	卫宁健康	10,113,441.95	6.98
31	601009	南京银行	9,800,344.44	6.77
32	601939	建设银行	9,602,573.80	6.63
33	300170	汉得信息	9,470,683.07	6.54
34	600196	复星医药	9,294,801.14	6.42
35	000681	视觉中国	9,227,418.97	6.37
36	000425	徐工机械	8,871,222.00	6.13
37	603108	润达医疗	8,831,494.34	6.10
38	002672	东江环保	8,742,081.00	6.04
39	600549	厦门钨业	8,613,173.28	5.95

40	600498	烽火通信	8,496,787.00	5.87
41	603799	华友钴业	8,477,734.80	5.85
42	600600	青岛啤酒	8,419,799.57	5.81
43	000066	中国长城	8,331,351.41	5.75
44	002680	长生生物	8,304,602.00	5.73
45	601766	中国中车	8,191,272.59	5.66
46	601333	广深铁路	8,177,321.00	5.65
47	600340	华夏幸福	8,120,499.69	5.61
48	600763	通策医疗	8,098,591.00	5.59
49	000661	长春高新	8,063,823.66	5.57
50	300098	高新兴	8,039,888.14	5.55
51	002690	美亚光电	7,878,404.00	5.44
52	002531	天顺风能	7,658,506.07	5.29
53	002410	广联达	7,535,199.60	5.20
54	600138	中青旅	7,458,372.40	5.15
55	002493	荣盛石化	7,438,557.00	5.14
56	300357	我武生物	7,309,911.61	5.05
57	000039	中集集团	7,309,678.83	5.05
58	000963	华东医药	7,061,101.00	4.88
59	000977	浪潮信息	7,032,472.00	4.86
60	002460	赣锋锂业	6,905,581.81	4.77
61	002507	涪陵榨菜	6,744,948.60	4.66
62	002440	闰土股份	6,638,751.92	4.58
63	601933	永辉超市	6,594,282.00	4.55
64	002008	大族激光	6,547,425.02	4.52
65	002405	四维图新	6,493,009.28	4.48
66	603883	老百姓	6,467,407.70	4.47
67	300529	健帆生物	6,384,580.83	4.41
68	601601	中国太保	6,376,379.20	4.40
69	603658	安图生物	6,234,285.30	4.31
70	601088	中国神华	6,174,697.66	4.26

71	600436	片仔癀	6,136,417.73	4.24
72	600588	用友网络	5,879,668.66	4.06
73	600366	宁波韵升	5,873,641.00	4.06
74	600036	招商银行	5,821,631.32	4.02
75	600884	杉杉股份	5,761,236.84	3.98
76	603111	康尼机电	5,727,848.00	3.96
77	600466	蓝光发展	5,705,959.39	3.94
78	603019	中科曙光	5,652,807.10	3.90
79	300601	康泰生物	5,515,237.80	3.81
80	600977	中国电影	5,481,739.00	3.79
81	000895	双汇发展	5,414,904.00	3.74
82	603708	家家悦	5,365,229.87	3.70
83	300136	信维通信	5,283,040.00	3.65
84	002262	恩华药业	5,269,148.00	3.64
85	002236	大华股份	5,248,397.00	3.62
86	601877	正泰电器	5,218,490.42	3.60
87	300212	易华录	5,174,078.00	3.57
88	300009	安科生物	5,108,444.32	3.53
89	002171	楚江新材	5,028,353.95	3.47
90	600585	海螺水泥	4,960,939.00	3.43
91	002185	华天科技	4,941,890.00	3.41
92	300166	东方国信	4,929,039.00	3.40
93	300059	东方财富	4,842,662.20	3.34
94	002419	天虹股份	4,812,680.44	3.32
95	600521	华海药业	4,669,062.83	3.22
96	600999	招商证券	4,632,252.63	3.20
97	002361	神剑股份	4,556,347.32	3.15
98	300168	万达信息	4,521,771.00	3.12
99	300122	智飞生物	4,475,576.54	3.09
100	600583	海油工程	4,420,498.74	3.05
101	000725	京东方 A	4,405,100.00	3.04

102	300347	泰格医药	4,379,312.00	3.02
103	601818	光大银行	4,324,758.60	2.99
104	600584	长电科技	4,304,028.60	2.97
105	002340	格林美	4,275,423.00	2.95
106	601336	新华保险	4,101,116.45	2.83
107	002341	新纶科技	4,046,955.94	2.79
108	601668	中国建筑	4,042,218.39	2.79
109	002640	跨境通	3,976,931.66	2.75
110	300251	光线传媒	3,884,227.00	2.68
111	002696	百洋股份	3,683,425.60	2.54
112	002368	太极股份	3,654,276.00	2.52
113	600115	东方航空	3,614,494.00	2.50
114	002007	华兰生物	3,594,918.00	2.48
115	601607	上海医药	3,513,239.00	2.43
116	603589	口子窖	3,340,348.00	2.31
117	300033	同花顺	3,211,750.00	2.22
118	002138	顺络电子	3,124,434.00	2.16
119	600867	通化东宝	3,068,036.85	2.12
120	002310	东方园林	3,057,836.00	2.11
121	300070	碧水源	3,024,242.00	2.09
122	002127	南极电商	3,016,349.00	2.08
123	002195	二三四五	2,999,618.00	2.07
124	601800	中国交建	2,993,665.50	2.07
125	002285	世联行	2,951,238.00	2.04
126	600373	中文传媒	2,941,026.00	2.03
127	601006	大秦铁路	2,909,530.00	2.01

注：1、表中卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、表中“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,017,895,489.47
卖出股票收入（成交）总额	1,089,915,574.53

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、表中“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	116,006.79
2	应收证券清算款	34,671,223.42
3	应收股利	-
4	应收利息	15,961.14
5	应收申购款	1,997.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,805,188.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
4,363	38,078.59	10,779,795.05	6.49%	155,357,114.02	93.51%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,228,353.35	1.34%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年12月30日)基金份额总额	1,568,594,317.69
本报告期期初基金份额总额	192,152,162.92
本报告期基金总申购份额	1,794,214.54
减：本报告期基金总赎回份额	27,809,468.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	166,136,909.07

注：上表列示的总申购份额含红利再投、转换入份额，列示的总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会,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

基金管理人的重大人事变动:2018年5月,浙江浙商证券资产管理有限公司董事长由吴承根先生变更为盛建龙先生。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内,无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,基金管理人、托管人的业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	1	659,782,986.35	31.31%	482,499.98	27.65%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	28,781,335.49	1.37%	21,047.79	1.21%	-
长江证券	1	107,648,463.02	5.11%	78,723.36	4.51%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	61,441,056.41	2.92%	44,932.23	2.57%	-
华创证券	1	148,935,047.09	7.07%	108,914.95	6.24%	-
申万宏源	1	81,192,875.40	3.85%	59,375.93	3.40%	-
浙商证券	2	1,019,500,501.73	48.38%	949,462.51	54.41%	-

a) 本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格，上海证券市场只能使用母公司浙商证券席位进行交易。截至报告期末，本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。本报告期内，交易单元无变更。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业

分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	1,498,200.00	100.00%	439,300,000.00	100.00%	-	-	-	-

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
2	关于增加基煜基金为浙江浙商证券资产管理有限公司旗	公司官网、上海证券报	2018-01-12

	下公募基金销售机构的公告		
3	关于增加北京肯特瑞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、上海证券报	2018-01-17
4	浙商汇金转型成长混合型证券投资基金2017年第4季度报告	公司官网、上海证券报	2018-01-19
5	关于增加挖财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、上海证券报	2018-01-30
6	浙商汇金转型成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018年第1号）	公司官网、上海证券报	2018-02-10
7	浙商汇金转型成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2018年第1号）	公司官网	2018-02-10
8	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、上海证券报	2018-02-28
9	浙商汇金转型成长混合型证券投资基金基金合同	公司官网	2018-03-23
10	浙商汇金转型成长混合型证券投资基金托管协议	公司官网	2018-03-23
11	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下浙商汇金转型成长混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告	公司官网、上海证券报	2018-03-23
12	浙商汇金转型成长混合型证券投资基金2017年年度报告	公司官网	2018-03-30
13	浙商汇金转型成长混合型证	公司官网、上海证券报	2018-03-30

	券投资基金2017年年度报告摘要		
14	浙江浙商证券资产管理有限公司关于增聘浙商汇金转型成长混合型证券投资基金基金经理的公告	公司官网、上海证券报	2018-04-20
15	浙商汇金转型成长混合型证券投资基金2018年第一季度报告	公司官网、上海证券报	2018-04-23
16	浙江浙商证券资产管理有限公司关于董事长变更的公告	公司官网、上海证券报	2018-05-26
17	关于浙商汇金转型成长混合型证券投资基金调整停牌股票估值办法的公告	公司官网、上海证券报	2018-06-29
18	浙商汇金转型成长混合型证券投资基金半年度最后一个市场交易日净值公告	公司官网、上海证券报	2018-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2018年7月，浙江浙商证券资产管理有限公司总经理李雪峰先生离任，由楼小平先生代为履行总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、2018年7月，浙江浙商证券资产管理有限公司财务负责人由盛建龙先生变更为冯建兰女士。上述人事变动已按相关规定备案。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准设立浙商汇金转型成长混合型证券投资基金的文件；
《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金基金合同》；
《浙商汇金转型成长混合型证券投资基金托管协议》；

报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人住所及托管人住所

12.3 查阅方式

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

浙江浙商证券资产管理有限公司
二〇一八年八月二十八日