

浙商日添利货币市场基金 2016 年半年度报 告 摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浙商日添利	
基金主代码	002077	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 8 日	
基金管理人	浙商基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,304,474,603.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	浙商日添利 A	浙商日添利 B
下属分级基金的交易代码:	002077	002078
报告期末下属分级基金的份额总额	34,640,886.22 份	2,269,833,717.58 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金根据对市场利率的研究与预判，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动管理投资策略，争取在满足安全性和流动性的前提下，实现较高的资产组合收益。
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浙商基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	田青
	联系电话	021-60350812	010-67595096
	电子邮箱	guoleqi@zsfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	010-67595096
传真		0571-28191919	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 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

基金级别	浙商日添利 A	浙商日添利 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,045,336.55	23,736,631.43
本期利润	1,045,336.55	23,736,631.43
本期净值收益率	1.3133%	1.4354%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	qiMoKeGongFenPeiJiJinFenELiRunA	-
期末基金资产净值	34,640,886.22	2,269,833,717.58
期末基金份额净值	1.00	1.00

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浙商日添利 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1793%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.1505%	0.0003%

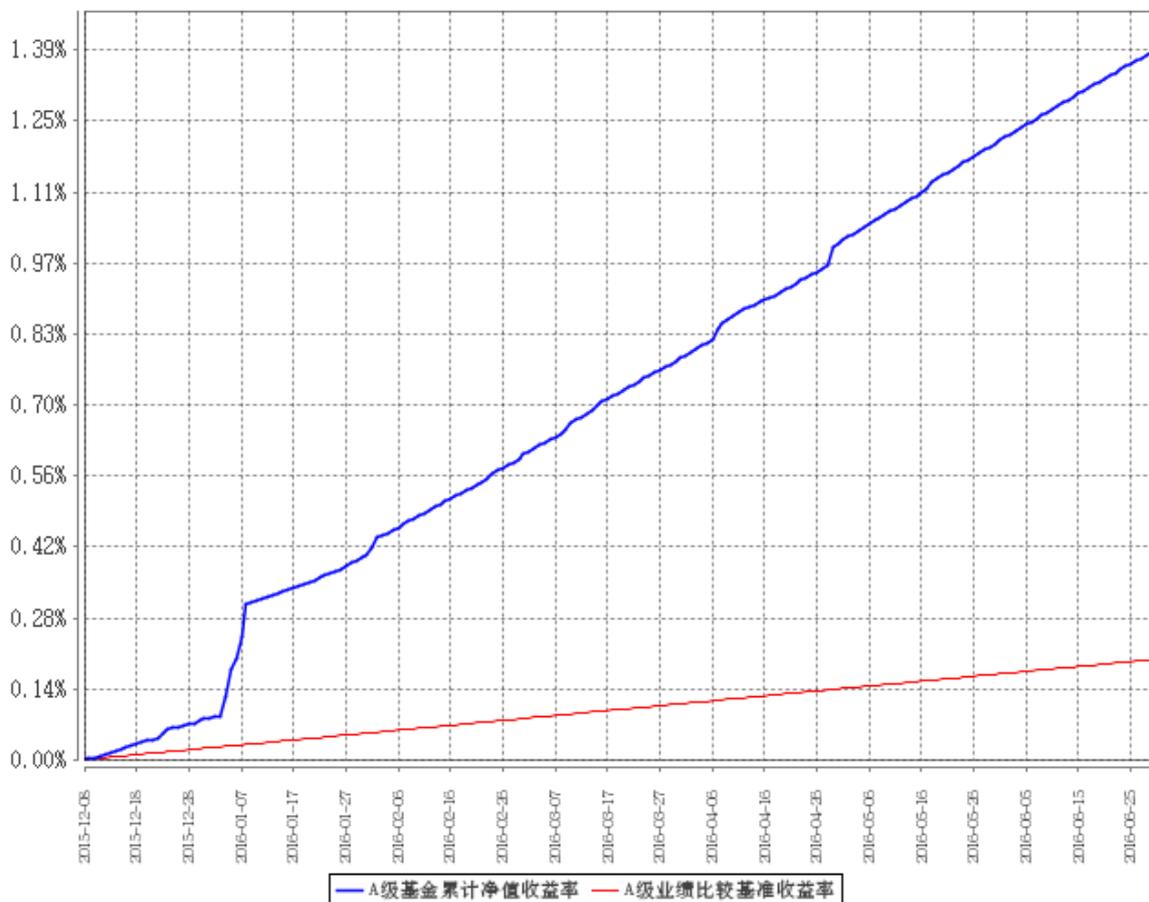
过去三个月	0.6032%	0.0038%	0.0873%	0.0000%	0.5159%	0.0038%
过去六个月	1.3133%	0.0073%	0.1745%	0.0000%	1.1388%	0.0073%
自基金合同生效起至今	1.3945%	0.0070%	0.1975%	0.0000%	1.1970%	0.0070%

浙商日添利 B

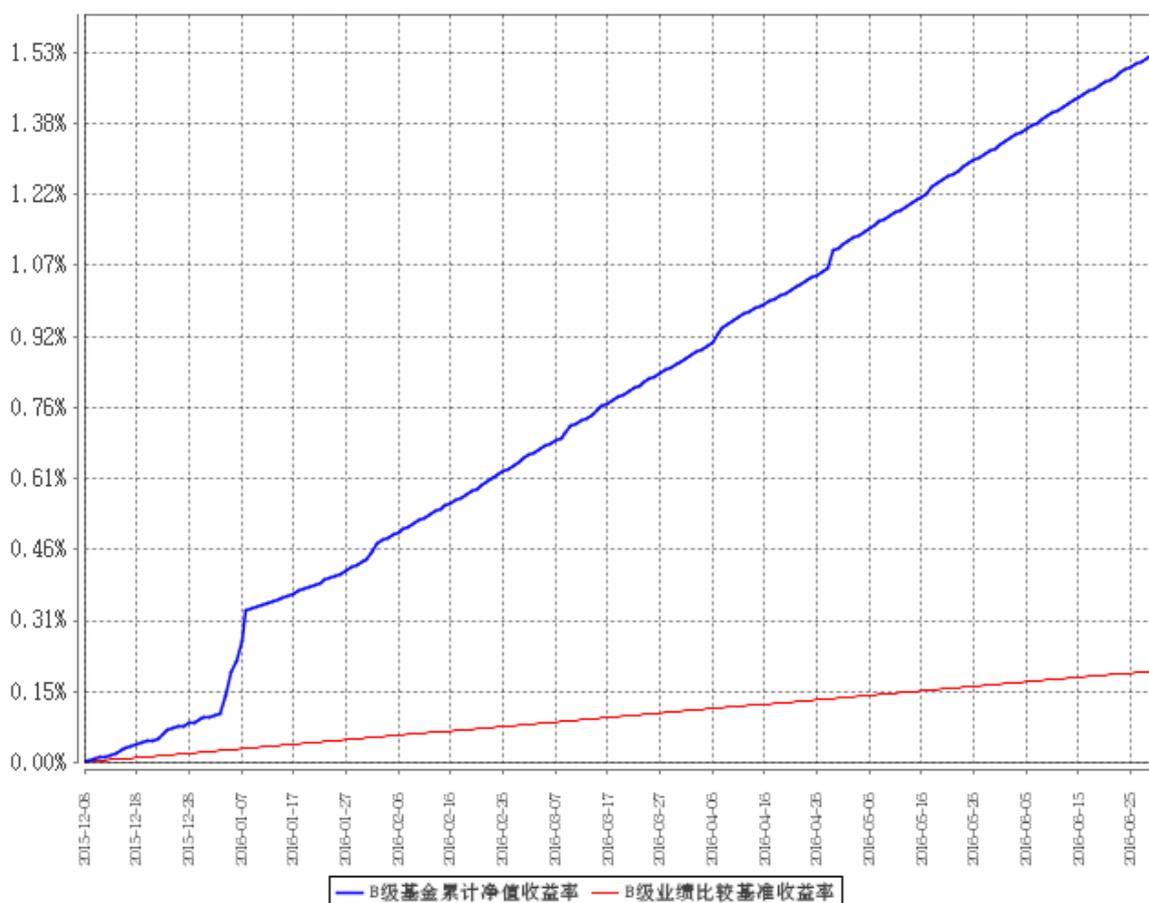
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1992%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.1704%	0.0003%
过去三个月	0.6635%	0.0038%	0.0873%	0.0000%	0.5762%	0.0038%
过去六个月	1.4354%	0.0073%	0.1745%	0.0000%	1.2609%	0.0073%
自基金合同生效起至今	1.5327%	0.0070%	0.1975%	0.0000%	1.3352%	0.0070%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 12 月 8 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2015 年 12 月 8 日至 2016 年 6 月 30 日。

2、本基金建仓期为 6 个月，从 2015 年 12 月 8 日至 2016 年 6 月 7 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2016 年 6 月 30 日，浙商基金共管理九只开放式基金——浙商聚潮产业成长混合型证券

投资基金、浙商聚潮新思维混合证券投资基金、浙商沪深 300 指数分级证券投资基金、浙商聚盈信用债债券型证券投资基金、浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金、浙商日添利货币市场基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金、浙商惠享纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吕文晔	本基金的基金经理，公司固定收益部基金经理	2016 年 2 月 15 日	-	4	吕文晔先生，英国华威大学过程工程和商业管理硕士。曾任平安资产管理有限责任公司交易部债券交易员。
洪慧梅	本基金的基金经理、固定收益部副总经理。	2015 年 12 月 8 日	2016 年 3 月 28 日	10	洪慧梅女士，同济大学经济与管理学院金融学硕士。历任平安资产管理有限责任公司集中交易部债券交易员，汇丰人寿保险有限责任公司投资管理部交易主任。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了规范公平交易行为，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规规

定，本公司制定了相应的公平交易制度。在投资决策层面，本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，对不同类别的投资组合分别管理、独立决策；在交易层面，实行集中交易制度，建立了公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会，严禁在不同投资组合之间进行利益输送；在监控和评估层面，本公司金融工程小组将每日审查当天的投资交易，对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，本基金未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金主要投资品种为债券、同业存单以及银行存款。一季度末和二季度初组合在市场收益率较低的位置主动降低了组合平均剩余期限，并在随后收益率大幅度上行的过程中逐步增加长期限资产的配置。资产结构方面继续坚持精选个券并不断加大同业存单的占比，使得组合在保持流动性处于较为安全水平的同时，将收益维持在相对稳定的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 06 月 30 日为止，报告期内浙商日添利 A 净值增长率为 1.3133%，业绩比较基准收益率为 0.1745%。基金净值增长率高于业绩比较基准 1.1388%；报告期内浙商日添利 B 净值增长率为 1.4354%，业绩比较基准收益率为 1.1745%。基金净值增长率高于业绩比较基准 1.2609%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年各项宏观经济数据包括通胀均呈现冲高回落态势，PPI 环比和同比降幅继续收窄。央行继续通过公开市场维持资金面的稳定，银行间市场流动性较为充沛且波动率有所减小。房地产

销售和投资增速 4 月份已基本见顶，后续放缓压力较大；制造业投资、民间投资持续放缓，基建新开工项目增速高位回落；社融和货币增速受去年基数较高影响短期内也会有所回落，从而进一步压制经济增长和通胀。海外方面英国脱欧降低金融市场风险偏好，使全球经济增长不确定性增加，同时也打乱了美联储加息节奏。基于上述分析，我们认为三季度债券收益率具备一定的下行空间，考虑到下半年利率债特别是地方债供给缩量，以及信用利差仍处在历史低位，利率债较信用债更具备配置价值，且存在波段操作的空间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期末未进行收益分配。

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

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司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

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：浙商日添利货币市场基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款		558,480,714.65	426,720,866.52
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		1,524,470,877.10	921,833,031.50
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,524,470,877.10	921,833,031.50
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		210,001,395.00	99,000,169.50
应收证券清算款		-	-
应收利息		12,505,079.59	18,449,974.27
应收股利		-	-
应收申购款		222,000.00	90,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,305,680,066.34	1,466,094,041.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		667,172.21	299,417.08
应付托管费		222,390.77	133,139.01
应付销售服务费		31,031.36	60,323.80
应付交易费用		24,183.55	10,170.75
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		179,181.51	58,112.98
递延所得税负债		-	-
其他负债		81,503.14	-
负债合计		1,205,462.54	561,163.62
所有者权益:			
实收基金		2,304,474,603.80	1,465,532,878.17
未分配利润		-	-
所有者权益合计		2,304,474,603.80	1,465,532,878.17
负债和所有者权益总计		2,305,680,066.34	1,466,094,041.79

6.2 利润表

会计主体：浙商日添利货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至	上年度可比期间 2015年1月1日至2015
-----	-----	------------------	---------------------------

		2016 年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、收入		28,950,627.81	-
1.利息收入		25,511,787.97	-
其中：存款利息收入		5,344,862.45	-
债券利息收入		18,204,176.16	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,962,749.36	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,438,839.84	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		3,438,839.84	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、费用		4,168,659.83	-
1. 管理人报酬		2,750,476.83	-
2. 托管费		916,825.64	-
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	180,596.31	-
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		190,870.50	-
其中：卖出回购金融资产支出		190,870.50	-
6. 其他费用		129,890.55	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,781,967.98	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,781,967.98	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商日添利货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,465,532,878.17	-	1,465,532,878.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	24,781,967.98	24,781,967.98
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)	838,941,725.63	-	838,941,725.63
其中：1.基金申购款	4,834,673,065.73	-	4,834,673,065.73
2.基金赎回款	-3,995,731,340.10	-	-3,995,731,340.10
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)	-	-24,781,967.98	-24,781,967.98
五、期末所有者权益(基金净值)	2,304,474,603.80	-	2,304,474,603.80
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

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：

李志惠
基金管理人负责人

唐生林
主管会计工作负责人

唐生林
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浙商日添利货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准浙商日添利货币市场基金募集的批复》(中国证监会证监许可【2015】2561号文)批准,由浙商基金管理有限公司(以下简称“浙商基金公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《浙商日添利货币市场基金基金合同》发售,基金合同于中国证监会证监许可 2015 年 12 月 08 日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为 2735599980.07 份额。本基金的基金管理人为浙商基金公司,基金托管人为建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《浙商日添利货币市场基金基金基金合同》和《浙商日添利货币市场基金基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括(1)现金;(2)通知存款;(3)一年以内(含一年)的银行存款、大额存单;(4)短期融资券(包含超级短期融资券);(5)剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、中期票据、资产支持证券;(6)期限在一年以内(含一年)的债券回购;(7)剩余期限在一年以内(含一年)的中央银行票据(8)法律法规或中国证监会允许货币市场基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款利率(税后)。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投

资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况、自 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金在报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在报告期内未发生过重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整

证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。
- (e) 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。
- (f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浙商基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
浙商证券股份有限公司	基金管理人的股东
通联资本管理有限公司	基金管理人的股东

浙江浙大网新集团有限公司	基金管理人的股东
养生堂有限公司	基金管理人的股东
上海聚潮资产管理有限公司	基金管理人的子公司
浙商基金股票优选 1 号资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
九派优选 1 号资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
聚潮资管远东租赁资产收益权分级 1 号专项资产管理计划	基金管理人的子公司管理的资产管理计划
聚潮资管远东租赁资产收益权分级 2 号资产管理计划	基金管理人的子公司管理的资产管理计划
聚潮资产-中科招商新三板 I 期 A 专项资产管理计划	基金管理人的子公司管理的资产管理计划
聚潮资产-中科招商新三板 I 期 B 专项资产管理计划	基金管理人的子公司管理的资产管理计划

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本报告期本基金没有通过关联方的交易单元进行过交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本报告期本基金没有通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本报告期本基金没有通过关联方的交易单元进行交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本报告期本基金没有通过关联方的交易单元进行交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期本基金没有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,750,476.83	-
其中：支付销售机构的客户维护费	126,480.28	-

注：支付基金管理人浙商基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的一定比例计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.3%/当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	916,825.64	-

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浙商日添利 A	浙商日添利 B	合计
浙商直销	1,197.44	86,582.51	87,779.95
建设银行	74,871.77	974.21	75,845.98
合计	76,069.21	87,556.72	163,625.93

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人本报告期内未持有过本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

浙商日添利 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
聚潮资产-中科招商新三板 I 期 A 专项资产管理计划	284,595.18	0.01%	-	-
聚潮资产-中科招商新三板 I 期 B 专项资产管理计划	64,574.08	-	-	-

浙商日添利 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
浙商基金股票优选 1 号资产管理计划	20,170,451.08	0.88%	-	-
九派优选 1 号资产管理计划	20,168,965.45	0.88%	-	-
聚潮资管远东租赁资产收益权分级 1 号专项资产管理计划	23,924,352.99	1.04%	-	-
聚潮资管远东租赁资产收益权分级 2 号资产管理计划	11,165,663.86	0.48%	-	-

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	8,480,714.65	226,798.99	-	-

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.10 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	固定收益投资	1,524,470,877.10	66.12
	其中: 债券	1,524,470,877.10	66.12
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	210,001,395.00	9.11
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	558,480,714.65	24.22
4	其他各项资产	12,727,079.59	0.55
5	合计	2,305,680,066.34	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.92	
	其中: 买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00
	其中: 买断式回购融资	0.00	0.00

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2016 年 4 月 7 日	20.69	巨额赎回	1 个交易日

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	22.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	29.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	18.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	16.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	12.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.50	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,288,592.27	5.65
	其中：政策性金融债	130,288,592.27	5.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	369,945,561.92	16.05
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,024,236,722.91	44.45
8	其他	-	-
9	合计	1,524,470,877.10	66.15
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明

细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	041556028	15 中煤平朔 CP001	1,000,000	99,945,357.20	4.34
2	111616084	16 上海银行 CD084	1,000,000	99,779,433.91	4.33
3	111610081	16 兴业 CD081	1,000,000	99,618,118.12	4.32
4	111608150	16 中信 CD150	1,000,000	99,603,528.64	4.32
5	011699137	16 中铝业 SCP002	800,000	79,960,169.15	3.47
6	111690891	16 杭州银行 CD030	800,000	79,644,648.78	3.46
7	111609196	16 浦发 CD196	600,000	59,296,153.39	2.57
8	011599869	15 沪城建 SCP001	500,000	50,015,890.78	2.17
9	011699261	16 豫能源	500,000	49,985,892.54	2.17

		SCP002			
10	111611125	16 平安 CD125	500,000	49,956,490.82	2.17

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1743%
报告期内偏离度的最低值	0.0016%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0753%

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

7.9.2

本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	12,505,079.59

4	应收申购款	222,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	12,727,079.59

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
浙商日添利 A	767	45,164.13	8,016,125.37	23.14%	26,624,760.85	76.86%
浙商日添利 B	18	126,101,873.20	2,269,833,717.58	100.00%	0.00	0.00%
合计	785	2,935,636.44	2,277,849,842.95	98.84%	26,624,760.85	1.16%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	浙商日添利 A	0.00	0.00%
	浙商日添利 B	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

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的情况

项目	份额级别	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	浙商日添利 A	0
	浙商日添利 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	浙商日添利 A	0
	浙商日添利 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	浙商日添利 A	浙商日添利 B
基金合同生效日（2015 年 12 月 8 日）基金 份额总额	416,563,398.68	2,319,036,581.39
本报告期期初基金份额总额	170,868,242.67	1,294,664,635.50
本报告期基金总申购份额	129,127,303.71	4,705,545,762.02
减：本报告期基金总赎回份额	265,354,660.16	3,730,376,679.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	34,640,886.22	2,269,833,717.58

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

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

2、券商专用交易单元选择程序：

- (1) 投资管理部、市场部

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

b、报公司分管领导审核通过。

(2) 中央交易室

- a、专员将我公司格式版本的《证券交易席位使用协议》发送给券商相关业务联系人。
- b、券商对我公司提供的协议有修改意见的，其内容若涉及投资管理部、市场部、运营保障部的，由专员分别将此内容发送给上述部门审议，并由专员将我公司各职能部门反馈的意见与券商进行商议，形成一致意见后完成协议初稿，交我公司监察稽核部审核。
- c、对券商和我公司双方同意的协议文本进行签字盖章。我公司盖章程序，由专员填写合同流转单，分别送达投资管理部、市场部、运营保障部、监察稽核部签字，最后盖章。

3、本基金报告期内券商交易单元变更情况：

- (1) 新增券商交易单元：方正证券（上交所交易单元）；

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

浙商基金管理有限公司
2016 年 8 月 24 日