

# 浙商日添利货币市场基金 2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2017 年 3 月 28 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。

毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 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	1,160,237,007.32 份	
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	53,317,800.24 份	1,106,919,207.08 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	tianqingl.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

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### § 3 主要财务指标、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	2016 年		2015 年 12 月 8 日(基金合同生效 日)-2015 年 12 月 31 日		2014 年	
	浙商日添利 A	浙商日添利 B	浙商日添利 A	浙商日添利 B	浙 商 日 添 利 A	浙 商 日 添 利 B
本期已 实现收 益	1,666,622.83	46,159,256.07	236,769.67	1,667,040.61	-	-
本期利 润	1,666,622.83	46,159,256.07	236,769.67	1,667,040.61	-	-
本期净 值收益 率	2.6268%	2.8743%	0.0801%	0.0959%	-	-
3.1.2 期末数 据和指 标	2016 年末		2015 年末		2014 年 末	
	期末基 金资产 净值	53,317,800.24	1,106,919,207.08	170,868,242.67	1,294,664,635.50	-
期末基 金份额 净值	-	-	-	-	-	-
3.1.3 累计期 末指标	2016 年末		2015 年末		2014 年 末	
	累计净 值收益 率	2.7090%	2.9730%	0.0801%	0.0959%	-

### 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
过去三个月	0.6624%	0.0058%	0.0882%	0.0000%	0.5742%	0.0058%
过去六个月	1.2965%	0.0053%	0.1764%	0.0000%	1.1201%	0.0053%
过去一年	2.6268%	0.0064%	0.3510%	0.0000%	2.2758%	0.0064%
自基金合同 生效起至今	2.7090%	0.0063%	0.3740%	0.0000%	2.3350%	0.0063%

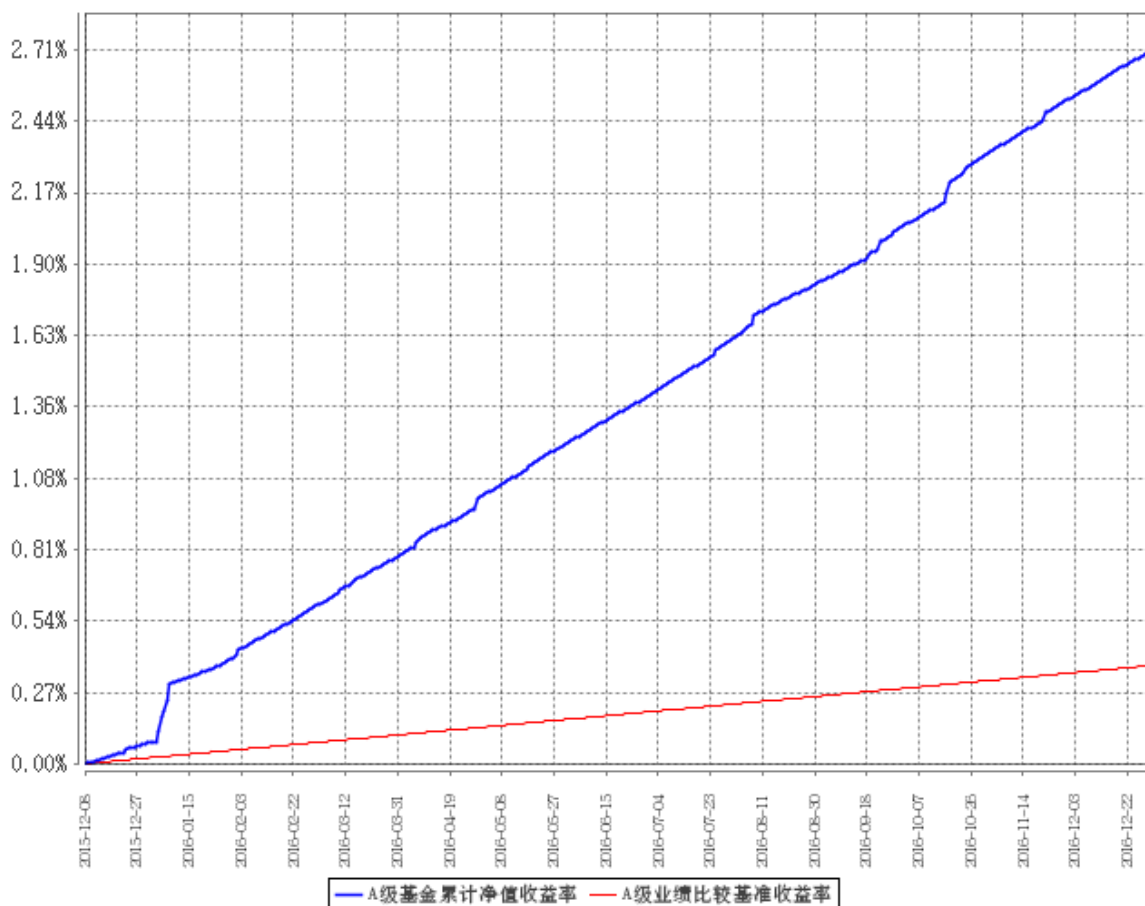
浙商日添利 B

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
过去三个月	0.7228%	0.0058%	0.0882%	0.0000%	0.6346%	0.0058%
过去六个月	1.4186%	0.0053%	0.1764%	0.0000%	1.2422%	0.0053%
过去一年	2.8743%	0.0064%	0.3510%	0.0000%	2.5233%	0.0064%
自基金合同 生效起至今	2.9730%	0.0063%	0.3740%	0.0000%	2.5990%	0.0063%

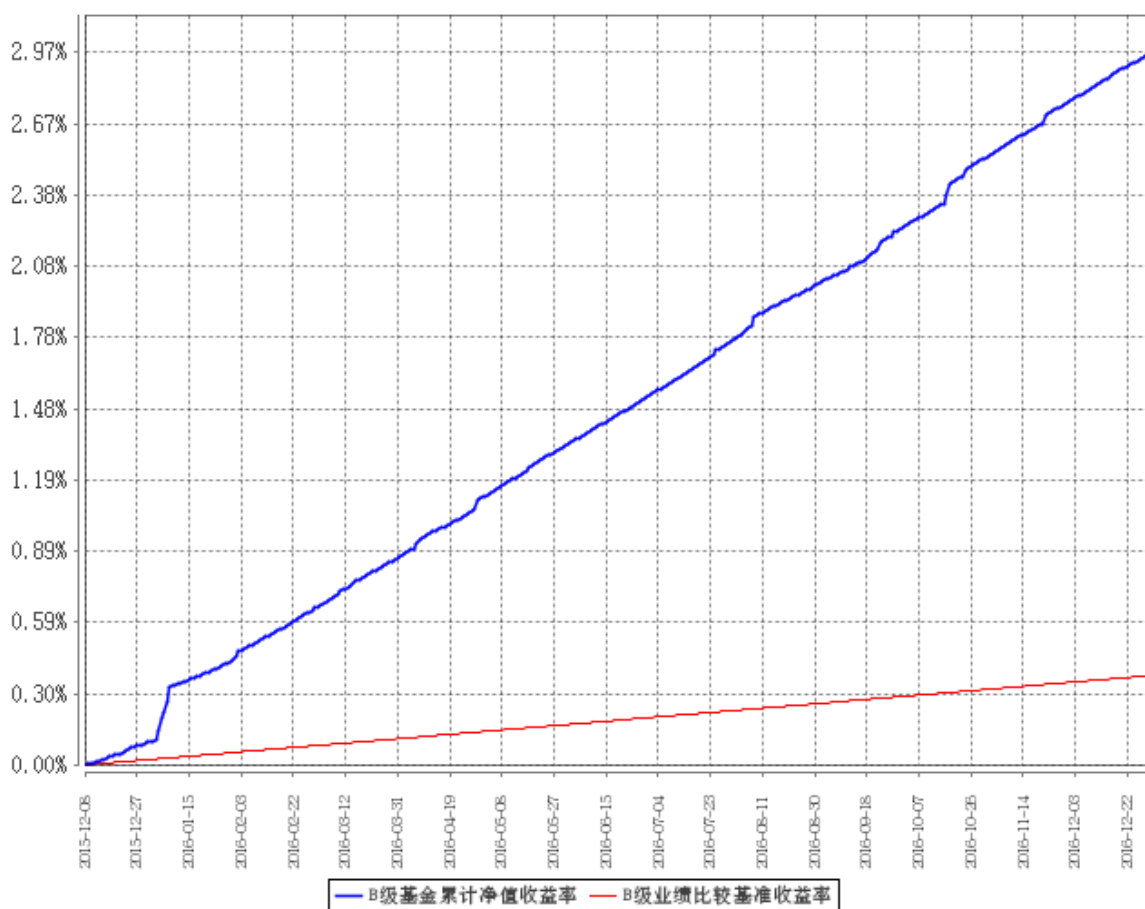
注：本基金的业绩比较基准人民币活期存款利率（税后）

### 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



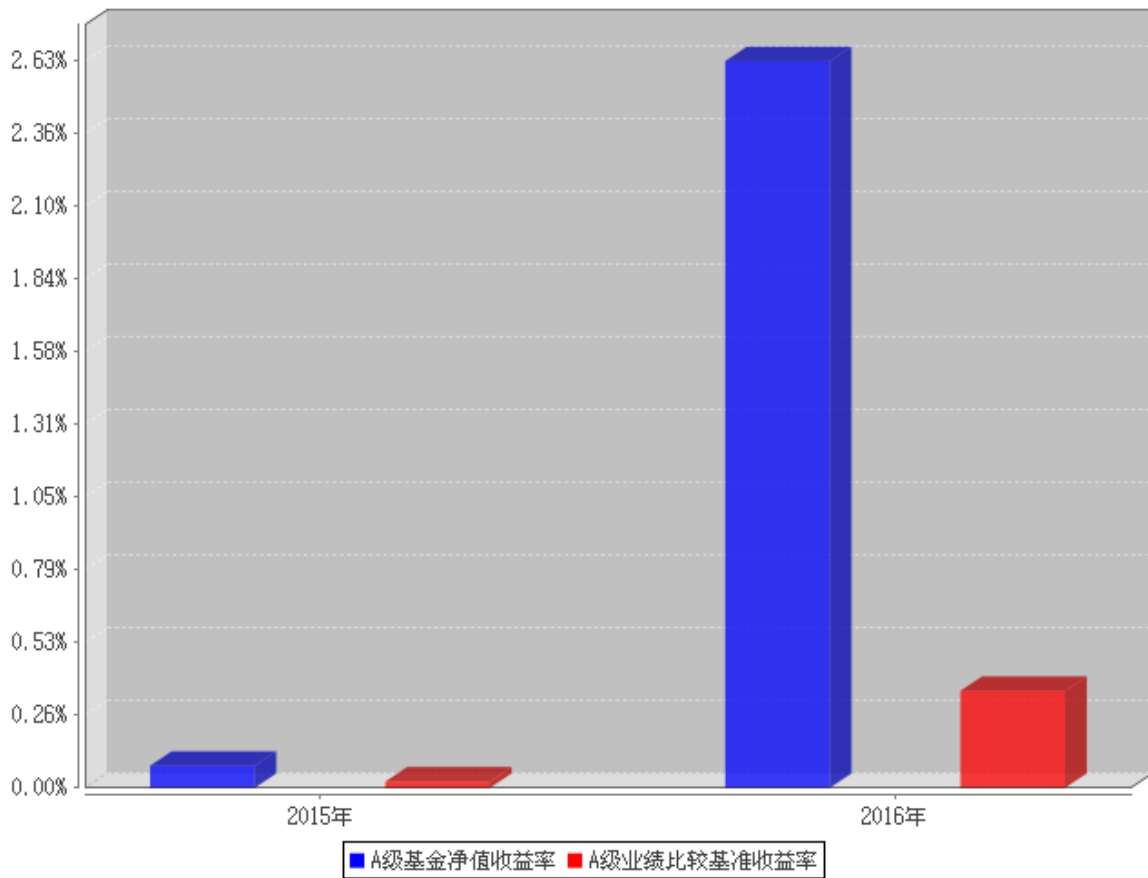
**B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



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，本基金运作时间已满一年。  
 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。

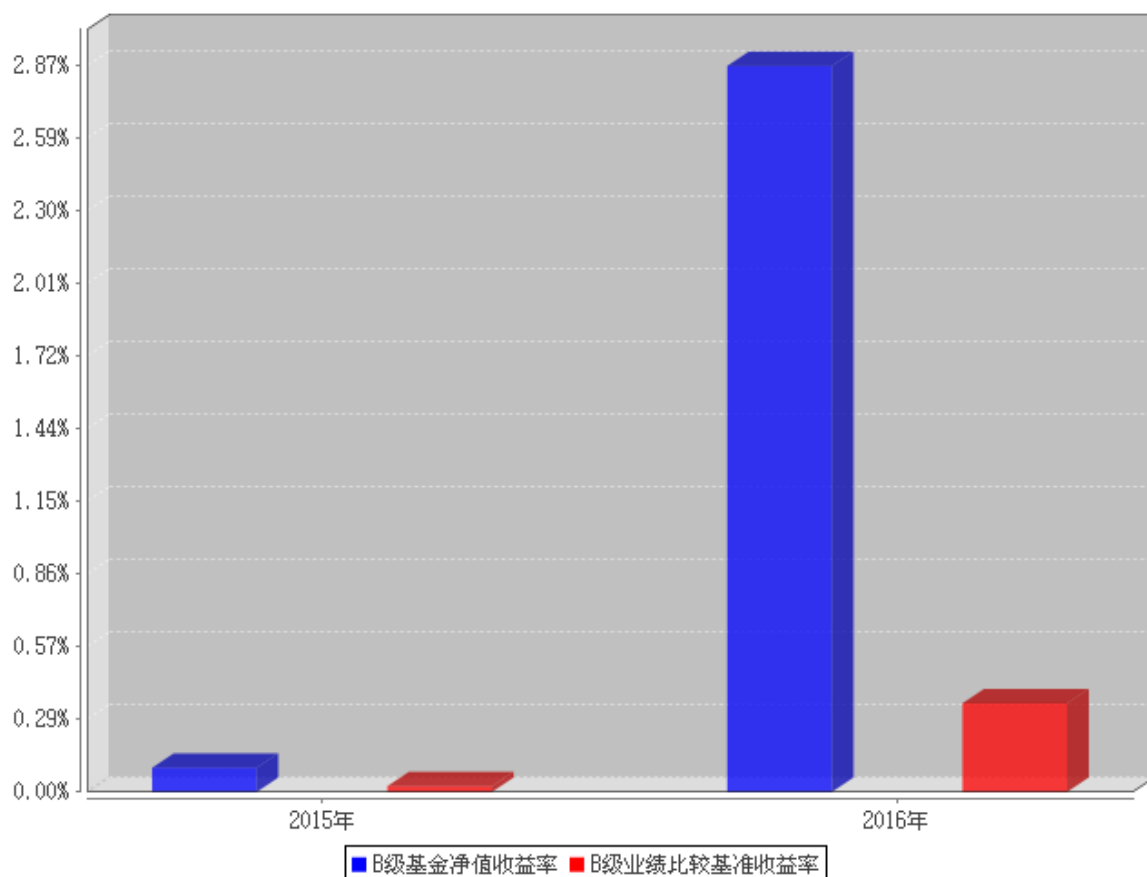
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图





### B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金 2015 年实际运作期间为 2015 年 12 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

浙商日添利 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016	1,663,626.55	-	2,996.28	1,666,622.83	-
2015	231,202.62	-	5,567.05	236,769.67	-
合计	1,894,829.17	-	8,563.33	1,903,392.50	-

单位：人民币元

浙商日添利 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016	46,019,385.93	-	139,870.14	46,159,256.07	-
2015	1,614,494.68	-	52,545.93	1,667,040.61	-
合计	47,633,880.61	-	192,416.07	47,826,296.68	-

## § 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。

至 2016 年 12 月 31 日,浙商基金共管理十四只开放式基金——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、浙商惠丰定期开放债券型证券投资基金、浙商惠利纯债债券型证券投资基金、浙商惠南纯债债券型证券投资基金、浙商惠裕纯债债券型证券投资基金、浙商日添金货币市场基金。

#### 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		
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。
吕文晔	本基金的基金经理	2016 年 2 月 15 日	-	5	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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金未发生违反公平交易制度的行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

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。2016 年全年由于资金面波动极大，组合久期持续保持在一个较低的水平。资产结构方面继续坚持精选个券，适度平衡了短融和存单的占比，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 12 月 31 日为止，报告期内浙商日添利 A 净值增长率为 2.6268%，业绩比较基准收益率为 0.3510%，基金净值增长率高于业绩比较基准 2.2758%；报告期内浙商日添利 B 净值增长率为 2.8743%，业绩比较基准收益率为 0.3510%，基金净值增长率高于业绩比较基准 2.5233%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度各项宏观经济数据随着房地产火爆以及消费的稳定增长而进一步改善，PPI 转正环比持续回升。央行三季度四季度开始通过缩短放长不断提高存量 MLF 的利率，银行间市场流动性特别是在年末尤为紧张。展望未来，由于一二线城市限购措施严厉，三四线城市房地产销售已出现恢复迹象并有望保持，基建投资在 PPP 的带动下也有望成为稳增长助力；社融和货币增速预计将小幅回落。海外方面需要特别关注美联储加息的节奏以及其对国内外汇占款的影响。基于上述分析，我们认为在二季度经济冲高回落时或许是配置债券的最佳时机。

#### 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《基金合同》约定：本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并全部分配，当日所得收益结转为基金份额参与下一日收益分配。

本基金本报告期 A 级共分配利润 1663626.55 元，其中已按红利再投资形式分配金额 1663626.55 元，B 级共分配利润 46019385.93 元，其中已按红利再投资形式分配金额 46019385.93 元。

#### 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，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。

#### 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 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	毕马威华振审字第 1700383 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	浙商日添利货币市场基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的第 1 页至第 37 页的浙商日添利货币市场基

	金(以下简称“浙商日添利基金”)财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度及自 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是浙商日添利基金管理人浙商基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价浙商基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为,浙商日添利基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注 2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了浙商日添利基金 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度及自 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	王国蓓   水青
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	399,070,393.89	426,720,866.52
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	318,547,217.45	921,833,031.50
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		318,547,217.45	921,833,031.50
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	439,995,380.00	99,000,169.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,220,803.33	18,449,974.27
应收股利		-	-
应收申购款		107,711.00	90,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,160,941,505.67	1,466,094,041.79
<b>负债和所有者权益</b>			
	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		219,295.26	299,417.08
应付托管费		73,098.40	133,139.01
应付销售服务费		20,582.63	60,323.80
应付交易费用	7.4.7.7	35,542.66	10,170.75
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		200,979.40	58,112.98
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	155,000.00	-
负债合计		704,498.35	561,163.62
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,160,237,007.32	1,465,532,878.17
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,160,237,007.32	1,465,532,878.17
负债和所有者权益总计		1,160,941,505.67	1,466,094,041.79

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 1,160,237,007.32 份。本基金 A 类份额净值为 1.000 元，份额总额 53,317,800.24 份；B 类份额净值为 1.000 元，份额总额 1,106,919,207.08 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 8 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		56,575,874.50	2,403,593.64
1. 利息收入		53,172,573.51	2,007,454.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,755,394.12	1,663,101.37
债券利息收入		38,747,071.19	260,993.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,670,108.20	83,359.81
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,403,300.99	396,139.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,403,300.99	396,139.04
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-



5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		8,749,995.60	499,783.36
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,262,523.33	299,417.08
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,754,174.47	133,139.01
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	323,461.58	60,323.80
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		1,156,361.54	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,156,361.54	-
6. 其他费用	7.4.7.20	253,474.68	6,903.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		47,825,878.90	1,903,810.28
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		47,825,878.90	1,903,810.28

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 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）	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（本期利润）	-	47,825,878.90	47,825,878.90
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）	-305,295,870.85	-	-305,295,870.85
其中：1. 基金申购款	8,638,289,878.49	-	8,638,289,878.49
2. 基金赎回款	-8,943,585,749.34	-	-8,943,585,749.34
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）	-	-47,825,878.90	-47,825,878.90
五、期末所有者权益（基金净值）	1,160,237,007.32	-	1,160,237,007.32

项目	上年度可比期间 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,735,599,980.07	-	2,735,599,980.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,903,810.28	1,903,810.28
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)	-1,270,067,101.90	-	-1,270,067,101.90
其中：1. 基金申购款	509,062,134.19	-	509,062,134.19
2. 基金赎回款	-1,779,129,236.09	-	-1,779,129,236.09
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)	-	-1,903,810.28	-1,903,810.28
五、期末所有者权益(基金净值)	1,465,532,878.17	-	1,465,532,878.17

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：

_____ 李志惠	_____ 唐生林	_____ 唐生林
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”）《关于准予浙商日添利货币市场基金注册的批复》（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 2015 年 12 月 8 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为浙商基金公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

本基金于 2015 年 11 月 26 日至 2015 年 12 月 4 日募集，募集期间净认购资金人民币 2,735,554,192.27 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 45,787.80 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 2,735,599,980.07 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所

(特殊普通合伙) 验证, 并出具了毕马威华振验字第 1500950 号验资报告。

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合同》和《浙商日添利货币市场基金招募说明书》的有关规定, 本基金的投资范围主要为法律法规及监管机构允许投资的金融工具, 包括现金, 通知存款, 一年以内(含一年)的银行存款、大额存单, 短期融资券(包含超级短期融资券), 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, 期限在一年以内(含一年)的债券回购, 剩余期限在一年以内(含一年)的中央银行票据, 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。

#### 7.4.2 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。

#### 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 12 月 31 日的财务状况、自 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币, 编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：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、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格（即相关金融工具的公允价值），以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金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

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到

0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

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

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

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

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用。本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配(该收益将会计确认为实收基金,参与下一日的收益分配),每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位,小数点后第3位按去尾原则处理,因去尾形成的余额进行再次分配,直到分完为止。本基金根据每日收益情况,将当日收益全部分配,若当日已实现收益大于零时,为投资人记正收益;若当日已实现收益小于零时,为投资人记负收益;若当日已实现收益等于零时,当日投资人不记收益。每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式。当日申购的基金份额自下一个工作日起,享有基金的收益分配权益;当日赎回的基金份额自下一个工作日起,不享有基金的收益分配权益。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

#### 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，本基金确定以下类债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007] 21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度及自 2015 年 12 月 8 日至 2015 年 12 月 31 日止期间均未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 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[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[2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016] 140 号文《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 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》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债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增) 试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改

为缴纳增值税。

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、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人) 通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2017 年 7 月 1 日(含) 以后, 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, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。因此, 截至 2016 年 12 月 31 日, 本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 对基金取得的债券的利息收入, 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。

(e) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人) 通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得, 暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人) 通过基金互认从内地基金分配取得的收益, 由发行债券的企业向该内地基金分配利息时, 对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税, 并由内地发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时, 不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(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。

#### 7.4.7 关联方关系

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
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



#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本年度与自 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间没有通过关联方的交易单元进行过交易。

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本报告期本基金没有通过关联方的交易单元进行过交易。

###### 7.4.8.1.2 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。

###### 7.4.8.1.3 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。

###### 7.4.8.1.4 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。

###### 7.4.8.1.5 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。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,262,523.33	299,417.08
其中：支付销售机构的客户维护费	188,710.34	121,612.50

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

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月	上年度可比期间 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效
----	-----------------------------------	-----------------------------------

	31 日	日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,754,174.47	133,139.01

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

### 7.4.8.2.3 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 12 月 31 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
建设银行	114,629.08	1,235.81	115,864.89
浙商基金	2,627.86	167,341.20	169,969.06
合计	117,256.94	168,577.01	285,833.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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
建设银行	48,739.84	1,822.13	50,561.97
浙商基金	4.03	9,520.39	9,524.42
合计	48,743.87	11,342.52	60,086.39

注：支付销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：浙商日添利 A 日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数  
浙商日添利 B 日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.01% / 当年天数

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金的管理人本报告期未持有过本基金。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

浙商日添利 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 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
九派优选 1 号 资产管理计划	20,453,100.31	1.76%	-	-

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 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
中国建设银行股 份有限公司	4,070,393.89	253,941.67	126,720,866.52	275,823.62

注：本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2016 年 12 月 31 日的相关余额为零(2015 年 12 月 31 日：零)。

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 利润分配情况

##### 7.4.9.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

##### 浙商日添利A

已按再投资形式转实收基 金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
1,663,626.55	-	2,996.28	1,666,622.83	-

##### 浙商日添利B

已按再投资形式转实收基 金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
46,019,385.93	-	139,870.14	46,159,256.07	-

#### 7.4.10 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.10.1 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。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

###### 7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 7.4.11 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	固定收益投资	318,547,217.45	27.44
	其中：债券	318,547,217.45	27.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	439,995,380.00	37.90
	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	399,070,393.89	34.37
4	其他各项资产	3,328,514.33	0.29
5	合计	1,160,941,505.67	100.00

## 8.2 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	3.07	
	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	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

## 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
2	2016 年 12 月 21 日	53.50	巨额赎回	1 个交易日
3	2016 年 12 月 15 日	21.95	巨额赎回	1 个交易日
4	2016 年 12 月 20 日	20.93	巨额赎回	2 个交易日
5	2016 年 12 月 7 日	31.60	巨额赎回	4 个交易日
6	2016 年 12 月 12 日	21.05	巨额赎回	1 个交易日
7	2016 年 12 月 8 日	31.60	巨额赎回	3 个交易日
8	2016 年 12 月 9 日	21.25	巨额赎回	2 个交易日

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	31
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	27

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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。

### 8.3.2 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	71.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	8.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	11.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	8.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.77	-

### 8.4 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。

### 8.5 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	70,004,391.87	6.03
	其中：政策性金融债	70,004,391.87	6.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,068,290.60	6.04
6	中期票据	-	-
7	同业存单	178,474,534.98	15.38
8	其他	-	-
9	合计	318,547,217.45	27.46
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 8.6 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	011699685	16 中建材 SCP004	500,000	50,050,298.23	4.31
2	160209	16 国开 09	500,000	50,004,520.95	4.31
3	111607106	16 招行 CD106	500,000	49,979,947.71	4.31
4	111696943	16 宁波通商银行 CD070	300,000	29,854,463.87	2.57
5	111680851	16 广州银行 CD091	300,000	29,594,406.52	2.55
6	111680811	16 邯郸银行 CD211	300,000	29,588,069.59	2.55
7	011620002	16 中铝 SCP002	200,000	20,017,992.37	1.73
8	160401	16 农发 01	200,000	19,999,870.92	1.72
9	111680871	16 贵阳银行 CD071	200,000	19,729,604.33	1.70
10	111680714	16 九台农村商业银行 CD049	200,000	19,728,042.96	1.70

## 8.7 “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	-0.1992%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0688%

## 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1

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。

### 8.9.2

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。

### 8.9.3 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	3,220,803.33
4	应收申购款	107,711.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,328,514.33

### 8.9.4 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。

## § 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

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	2,131	25,020.08	5,844,960.25	10.96%	47,472,839.99	89.04%



利 A						
浙商日添利 B	12	92,243,267.76	1,094,465,960.77	98.87%	12,453,246.31	1.13%
合计	2,143	541,407.84	1,100,310,921.02	94.84%	59,926,086.30	5.16%

## 9.2 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	9.00	0.00%
	浙商日添利 B	0.00	0.00%
	合计	9.00	0.00%

## § 10 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	272,531,286.07	8,365,758,592.42
减：本报告期基金总赎回份额	390,081,728.50	8,553,504,020.84
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	53,317,800.24	1,106,919,207.08

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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

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。本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 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。

### 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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

### 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）。

## 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	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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  
2017 年 3 月 31 日