

# 浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	65
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.....	65
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.....	65
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12 投资组合报告附注.....	66
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>67</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	67
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	68
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>69</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>70</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	72
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>74</b>

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 .....	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>75</b>
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	浙商沪深 300 指数分级		
场内简称	浙商 300		
基金主代码	166802		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 5 月 7 日		
基金管理人	浙商基金管理有限公司		
基金托管人	华夏银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	197,688,863.13 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 7 月 13 日		
下属分级基金的基金简称	浙商稳健	浙商进取	浙商沪深 300 指数分级
下属分级基金的交易代码	150076	150077	166802
报告期末下属分级基金份额总额	1,926,549.00 份	1,926,550.00 份	193,835,764.13 份

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浙商基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	郑鹏
	联系电话	021-60350812	010-85238667
	电子邮箱	guoleqi@zsfund.com	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	95577
传真		0571-28191919	010-85238680
注册地址		浙江省杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址		浙江省杭州市西湖区教工路 18 号世贸丽晶欧美中心 B 座 507 室	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码		310012	100005
法定代表人		肖风	李民吉

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	5,072,366.01
本期利润	18,855,785.70
加权平均基金份额本期利润	0.1222
本期加权平均净值利润率	10.65%
本期基金份额净值增长率	11.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	68,123,263.95
期末可供分配基金份额利润	0.3446
期末基金资产净值	242,656,549.65
期末基金份额净值	1.227
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	38.80%

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.23%	0.60%	4.73%	0.64%	0.50%	-0.04%
过去三个月	8.20%	0.55%	5.80%	0.59%	2.40%	-0.04%
过去六个月	11.09%	0.50%	10.24%	0.54%	0.85%	-0.04%
过去一年	17.56%	0.75%	15.46%	0.63%	2.10%	0.12%
过去三年	65.22%	1.64%	66.04%	1.66%	-0.82%	-0.02%
自基金合同生效起至今	38.84%	1.47%	34.25%	1.49%	4.59%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。由于基金资产配置比例处于动



态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2012 年 5 月 7 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间已满一年。  
2、本基金建仓期为 6 个月，从 2012 年 5 月 7 日至 2012 年 11 月 6 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2017 年 6 月 30 日,浙商基金共管理十五只开放式基金——浙商大数据智选消费混合型证券投资基金、浙商沪深 300 指数分级证券投资基金、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、浙商惠享纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈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、浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金、浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合证券投资基金、浙商聚盈信用债债券型证券投资基金、浙商日添利货币市场基金、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		
查晓磊	本基金的基金经理,公司衍生品及量化投资部总经理	2015 年 8 月 11 日	-	6	查晓磊先生,香港中文大学财务学博士。历任博时基金管理有限公司投资策略及大宗商品分析师。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内,本基金未发生违反公平交易制度的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本基金通过投资约束和数量化控制,按照基金合同的要求,使用定量分析等技术,分析和应对导致基金跟踪误差的因素,积极应对市场的剧烈变化,努力将基金的跟踪误差控制在较低水平,实现基金约定的投资策略,达到相应的投资目的。报告期内,本基金持续优化指数跟踪策略,针对基金规模小,申购赎回对净值波动影响大的情况,尽力做了对应,较好的完成了跟踪目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.227 元;本报告期基金份额净值增长率为 11.09%,业绩比较基准收益率为 10.24%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历了二月份以后宏观经济阶段性高点有所回落后,以 PMI 为代表的一些指标表征了经济在六月份再次稳定的迹象。最为敏感的大宗商品也有所异动。对未来经济的走势,我们需要结合

更多的数据及微观的印证提升我们判断的概率，但有一定基本可以确定，中国经济的韧性是很强的。同时，海外经济，尤其是欧洲的情况，都在同步性的转好，国际贸易复苏也被越来越多的人谈及，当然这些还尚未形成较为一致的预期。

流动性实际上是主导市场短期波动的重要变量。第二季度的加强监管，对市场形成了冲击，但从长期看，一方面是释放了当期的潜在风险，另一方面实际上夯实了未来良性发展的基础。因此，短期的冲击是暂时的，更不能理解为是整体货币政策大幅转向的标志。

市场在接下来对盈利和估值的定价还将很看重。但集中追逐大市值公司的局面可能趋于缓和，规模因素趋于中性。对于消费行业，顺应需求的子行业仍会得到市场积极响应。我们将继续通过多维前瞻的大数据体系，积极努力发现投资机会。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据基金合同约定，本基金不进行收益分配。

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

本基金本报告期内存在连续二十个工作日基金资产不足 5000 万的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，浙商沪深 300 指数分级证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2017 年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：浙商沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,339,946.50	1,367,472.76
结算备付金		-	57,644.89
存出保证金		181,477.03	11,395.59
交易性金融资产	6.4.7.2	233,825,902.41	24,270,702.29
其中：股票投资		227,485,449.21	24,270,702.29
基金投资		-	-
债券投资		6,340,453.20	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		34,347.24	-
应收利息	6.4.7.5	48,436.77	373.66
应收股利		-	-
应收申购款		6,766.30	1,237.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		243,436,876.25	25,708,827.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	25.27
应付赎回款		252,168.71	737.73
应付管理人报酬		193,848.23	32,560.81
应付托管费		42,646.62	7,163.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	117,479.00	54,424.95

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	174,184.04	205,602.75
负债合计		780,326.60	300,514.90
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	174,533,285.70	20,303,921.71
未分配利润	6.4.7.10	68,123,263.95	5,104,390.50
所有者权益合计		242,656,549.65	25,408,312.21
负债和所有者权益总计		243,436,876.25	25,708,827.11

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.227 元，基金份额总额 197,688,863.13 份。本基金浙商稳健份额净值为 1.022 元，份额总额 1,926,549.00 份；浙商进取份额净值为 1.432 元，份额总额 1,926,550.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		20,649,846.57	-8,559,304.41
1.利息收入		100,916.95	13,874.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	37,593.85	13,874.96
债券利息收入		54,625.81	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,697.29	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,763,655.36	-1,709,996.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,873,090.75	-2,186,202.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,890,564.61	476,206.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,783,419.69	-6,875,196.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,854.57	12,013.82
<b>减：二、费用</b>		1,794,060.87	582,027.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	848,067.64	269,984.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	186,574.91	59,396.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	535,995.99	55,580.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	223,422.33	197,065.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		18,855,785.70	-9,141,331.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		18,855,785.70	-9,141,331.85

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	20,303,921.71	5,104,390.50	25,408,312.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,855,785.70	18,855,785.70
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）	154,229,363.99	44,163,087.75	198,392,451.74
其中：1.基金申购款	156,135,452.82	44,760,179.95	200,895,632.77
2.基金赎回款	-1,906,088.83	-597,092.20	-2,503,181.03
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）	174,533,285.70	68,123,263.95	242,656,549.65



项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	43,768,037.15	17,273,839.22	61,041,876.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,141,331.85	-9,141,331.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,042,024.70	48,466.85	1,090,491.55
其中：1.基金申购款	9,863,885.46	1,488,981.58	11,352,867.04
2.基金赎回款	-8,821,860.76	-1,440,514.73	-10,262,375.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	44,810,061.85	8,180,974.22	52,991,036.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

浙商沪深 300 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准浙商沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]91 号文)批准,由浙商基金管理有限公司(以下称“浙商基金公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 28 日至 2012 年 4 月 27 日公开发售,募集资金总额人民币 354,249,853.79 元,其中扣除认购费后的有效认购资金人民币 354,249,853.79 元,有效认购资金在募集期间产生利息人民币 113,748.38 元,共折合 354,363,602.17 份基金份额。上述募集资金已经毕马威华振会计师事务

所(特殊普通合伙)验证,并出具了 KPMG-B(2012) CR No. 0034 号验资报告。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,基金合同已于 2012 年 5 月 7 日生效。本基金的基金管理人为浙商基金公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司(以下称“华夏银行”)。

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

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

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

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

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

## 6.4.2 会计报表的编制基础

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

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日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与最近一期年度会计报表所采用的会计政策一致。

### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

人民币

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的

金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(i) 股票投资

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

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

(ii) 债券投资

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

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

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

(iii) 权证投资

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

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

(b) 应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法

与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本，终止确认或摊销时收入计入当期损益。

#### (c) 其他金融负债

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

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

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

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

#### (a) 股票投资

(i) 对因特殊事项长期停牌的股票，如该停牌股票对基金资产净值产生重大影响，则采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。即在估值日，以公开发布的相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率计算该股票当日的公允价值。

(ii) 送股、转增股、配股和公开增发新股，按估值日在证券交易所上市的一股票的收盘价

估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。

(iii) 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(iv) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值。

(v) 非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一股票的收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所上市的同一股票的收盘价估值；若在证券交易所上市的同一股票的收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，其两者之间的差价按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例确认为估值增值。

#### (b) 债券投资

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

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

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

(iv) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易，按债券所处市场分别估值。

#### (c) 权证投资

(i) 首次公开发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

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

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。  
实际成本与估值的差异计入“公允价值变动收益/(损失)”科目。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于年末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于卖出交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

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

衍生工具收益/(损失)于卖出交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除权除息日确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代

缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

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

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率逐日计提;

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

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

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

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

H 为每日应计提的标的指数许可使用基点费, E 为前一日的基金资产净值

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

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期



内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

#### 6.4.4.12 分部报告

-

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用的行业指数为中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

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

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

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在报告期内未发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 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[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》、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股票、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) 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。

(e) 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。

(f) 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，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或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，并由内地上市公司或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。

(g) 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。

(h) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	9,339,946.50
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,339,946.50

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	214,450,090.18	227,485,449.21	13,035,359.03
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,370,364.00	6,340,453.20
	银行间市场	-	-
	合计	6,370,364.00	6,340,453.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	220,820,454.18	233,825,902.41	13,005,448.23

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,670.64
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	46,692.58
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	73.53
合计	48,436.77

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	117,479.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	117,479.00

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	161.71
审计费	24,795.19
信息披露费	69,424.36
上市费	29,752.78
指数使用费	50,050.00
合计	174,184.04

### 6.4.7.9 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 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,549,353.17	20,303,921.71
本期申购	177,298,549.16	156,135,452.82
本期赎回(以“-”号填列)	-2,159,039.20	-1,906,088.83
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	197,688,863.13	174,533,285.70

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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

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

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

浙商稳健和浙商进取的本期申购是指由浙商沪深 300 指数分级的“分拆”行为带来的该类基金份额的增加，本期赎回是指因浙商稳健和浙商进取的“合并”行为导致的该类基金份额的减少。浙商沪深 300 指数分级的本期申购份额包含浙商稳健和浙商进取的份额合并的份额 769,660.00 以及浙商稳健份额、浙商沪深 300 份额报告期内的定期份额折算所增加的份额 455,498.58；本期赎回份额包含浙商稳健和浙商进取的份额拆出的份额 160,314.00。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	9,746,531.10	-4,642,140.60	5,104,390.50
本期利润	5,072,366.01	13,783,419.69	18,855,785.70
本期基金份额交易产生的变动数	73,089,178.63	-28,926,090.88	44,163,087.75
其中：基金申购款	74,010,844.91	-29,250,664.96	44,760,179.95
基金赎回款	-921,666.28	324,574.08	-597,092.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,908,075.74	-19,784,811.79	68,123,263.95

#### 6.4.7.11 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6月30日
活期存款利息收入	28,268.48
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	4,351.13
其他	4,974.24
合计	37,593.85

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	112,070,354.08
减：卖出股票成本总额	107,197,263.33
买卖股票差价收入	4,873,090.75

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无权证投资收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-

注：本基金本报告期无其他衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,890,564.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,890,564.61



**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	13,783,419.69
——股票投资	13,813,330.49
——债券投资	-29,910.80
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	13,783,419.69

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,854.57
合计	1,854.57

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	535,995.99
银行间市场交易费用	-
合计	535,995.99

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	69,424.36

上市费	29,752.78
指数使用费	99,450.00
合计	223,422.33

#### 6.4.7.21 分部报告

-

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浙商基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
华夏银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
浙商证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
通联资本管理有限公司	基金管理人的股东
浙江浙大网新集团有限公司	基金管理人的股东
养生堂有限公司	基金管理人的股东
上海聚潮资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行股票交易。

### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及去年同期均没有应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	848,067.64	269,984.74
其中：支付销售机构的客户维护费	32,541.26	33,896.18

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

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	186,574.91	59,396.66

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

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	浙商稳健	浙商进取	浙商沪深 300 指数 分级
基金合同生效日 (2012 年 5 月 7 日) 持有的基金份额	-	-	0.00
期初持有的基金份额	-	-	2,823,406.03
期间申购/买入总份额	-	-	0.00
期间因拆分变动份额	-	-	57,033.65
减：期间赎回/卖出总 份额	-	-	0.00
期末持有的基金份额	-	-	2,880,439.68
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	1.46%

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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有 限公司	9,339,946.50	28,268.48	3,753,828.71	13,318.12

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及去年同期均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本期间未进行利润分配，该处理符合基金利润分配原则。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37
300671	富满	2017年	2017	新股流	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62

	电子	6月27日	2017年7月5日	通受限					
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76

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

#### 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
600050	中国联通	2017年4月5日	筹划重大事项	7.47	2017年8月21日	8.22	183,598	1,321,922.78	1,371,477.06
601989	中国重工	2017年5月31日	重大资产重组	6.21	-	-	214,308	1,665,400.65	1,330,852.68
601088	中国神华	2017年6月5日	筹划重大事项	22.29	-	-	57,451	1,017,633.77	1,280,582.79
601727	上海电气	2017年6月22日	重大资产重组	7.57	2017年7月3日	7.54	164,309	1,237,315.44	1,243,819.13
002252	上海	2017	筹	20.24	-	-	57,025	1,165,270.53	1,154,186.00

	莱士	年 6 月 21 日	划重大事项						
600795	国电电力	2017 年 6 月 5 日	重大资产重组	3.60	-	-	276,062	932,183.78	993,823.20
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	筹划重大事项	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	159,066	589,499.60	545,596.38
600100	同方股份	2017 年 4 月 21 日	重大资产重组	14.12	-	-	37,135	517,121.36	524,346.20
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大资产重组	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	86,300	554,016.96	461,705.00
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	重大资产重组	10.57	-	-	26,390	294,877.01	278,942.30
601872	招商轮船	2017 年 5 月 2 日	筹划重大事项	5.16	-	-	48,000	257,389.87	247,680.00
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大资	30.68	-	-	6,311	251,859.53	193,621.48

		日	产重组						
601608	中信重工	2017年4月19日	筹划重大事项	5.54	2017年7月26日	5.26	28,900	163,845.90	160,106.00
000503	海虹控股	2017年5月11日	重大资产重组	24.93	-	-	4,015	178,643.76	100,093.95
002129	中环股份	2016年7月6日	筹划重大事项	8.27	-	-	8,363	106,711.44	69,162.01
600485	信威集团	2016年12月26日	重大资产重组	14.59	-	-	4,065	74,640.28	59,308.35
600666	奥瑞德	2017年4月27日	重大资产重组	17.40	-	-	3,040	55,438.91	52,896.00
002426	胜利精密	2017年1月16日	筹划重大事项	7.68	-	-	5,100	46,329.58	39,168.00
002049	紫光国芯	2017年2月20日	重大资产重组	30.82	2017年7月17日	27.74	1,100	34,488.00	33,902.00



			组						
603501	韦尔股份	2017年6月5日	重大资产重组	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55
600654	*ST中安	2017年6月7日	重大资产重组	13.48	-	-	900	15,759.00	12,132.00

注：截至本报告批准报出日，“中国重工、中国神华、上海莱士、国电电力、同方股份、江苏有线、招商轮船、乐视网、海虹股份、中环股份、信威集团、奥瑞德、胜利精密、韦尔股份、\*ST中安”仍未复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，浙商稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征；浙商进取份额具有高风险、高预期收益的特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资及股指期货投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,339,946.50	-	-	-	-	-	9,339,946.50
存出保证金	181,477.03	-	-	-	-	-	181,477.03
交易性金融资产	-	6,340,453.20	-	-	-	227,485,449.21	233,825,902.41
应收证券清算款	-	-	-	-	-	34,347.24	34,347.24

应收利息	-	-	-	-	-	48,436.77	48,436.77
应收申购款	-	-	-	-	-	6,766.30	6,766.30
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,521,423.53	6,340,453.20	-	-	-	227,574,999.52	243,436,876.25
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	252,168.71	252,168.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	193,848.23	193,848.23
应付托管费	-	-	-	-	-	42,646.62	42,646.62
应付交易费用	-	-	-	-	-	117,479.00	117,479.00
其他负债	-	-	-	-	-	174,184.04	174,184.04
负债总计	-	-	-	-	-	780,326.60	780,326.60
利率敏感度缺口	9,521,423.53	6,340,453.20	-	-	-	-226,794,672.92	242,656,549.65
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	1,367,472.76	-	-	-	-	-	1,367,472.76
结算备付金	57,644.89	-	-	-	-	-	57,644.89
存出保证金	11,395.59	-	-	-	-	-	11,395.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	24,270,702.29	24,270,702.29
应收利息	-	-	-	-	-	373.66	373.66
应收申购款	-	-	-	-	-	1,237.92	1,237.92
资产总计	1,436,513.24	-	-	-	-	24,272,313.87	25,708,827.11
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	25.27	25.27
应付赎回款	-	-	-	-	-	737.73	737.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,560.81	32,560.81
应付托管费	-	-	-	-	-	7,163.39	7,163.39
应付交易费用	-	-	-	-	-	54,424.95	54,424.95
其他负债	-	-	-	-	-	205,602.75	205,602.75
负债总计	-	-	-	-	-	300,514.90	300,514.90
利率敏感度缺口	1,436,513.24	-	-	-	-	-23,971,798.97	25,408,312.21

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	3,578.37	0.00
	市场利率上升 25 个基点	-3,578.37	0.00

	基点		
--	----	--	--

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 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	227,485,449.21	93.75	24,270,702.29	95.52
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	6,340,453.20	2.61	-	-
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	233,825,902.41	96.36	24,270,702.29	95.52

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	11,418,442.89	1,225,670.47
	沪深 300 指数下降 5%	-11,418,442.89	-1,225,670.47

#### 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	227,485,449.21	93.45
	其中：股票	227,485,449.21	93.45
2	固定收益投资	6,340,453.20	2.60
	其中：债券	6,340,453.20	2.60
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,339,946.50	3.84
7	其他各项资产	271,027.34	0.11
8	合计	243,436,876.25	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	544,014.16	0.22
B	采矿业	9,746,249.65	4.02
C	制造业	81,909,123.06	33.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,707,452.52	2.76
E	建筑业	12,682,835.00	5.23
F	批发和零售业	5,047,915.07	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	7,402,513.26	3.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,382,428.01	2.63
J	金融业	78,965,471.91	32.54
K	房地产业	10,817,494.68	4.46
L	租赁和商务服务业	2,185,953.92	0.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,328,693.37	0.55

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	334,900.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	2,768,230.40	1.14
S	综合	662,174.20	0.27
	合计	227,485,449.21	93.75

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	181,528	9,005,604.08	3.71
2	600036	招商银行	248,094	5,931,927.54	2.44
3	601166	兴业银行	286,545	4,831,148.70	1.99
4	601818	光大银行	1,114,308	4,512,947.40	1.86
5	600016	民生银行	528,515	4,344,393.30	1.79
6	000651	格力电器	104,898	4,318,650.66	1.78
7	000333	美的集团	97,359	4,190,331.36	1.73
8	600519	贵州茅台	8,677	4,094,242.45	1.69
9	601328	交通银行	658,116	4,053,994.56	1.67
10	600000	浦发银行	302,600	3,827,890.00	1.58
11	000002	万科A	153,200	3,825,404.00	1.58
12	601288	农业银行	1,008,508	3,549,948.16	1.46
13	601668	中国建筑	339,246	3,283,901.28	1.35
14	600030	中信证券	173,669	2,955,846.38	1.22
15	600887	伊利股份	135,348	2,922,163.32	1.20
16	601169	北京银行	311,218	2,853,869.06	1.18
17	600837	海通证券	178,609	2,652,343.65	1.09
18	601398	工商银行	500,802	2,629,210.50	1.08
19	600104	上汽集团	84,517	2,624,252.85	1.08
20	600900	长江电力	152,139	2,339,897.82	0.96
21	000858	五粮液	41,996	2,337,497.36	0.96
22	000001	平安银行	240,878	2,261,844.42	0.93
23	601766	中国中车	223,019	2,256,952.28	0.93



24	000725	京东方 A	513,947	2,138,019.52	0.88
25	601211	国泰君安	99,500	2,040,745.00	0.84
26	002415	海康威视	61,212	1,977,147.60	0.81
27	601186	中国铁建	159,264	1,915,945.92	0.79
28	601390	中国中铁	217,661	1,887,120.87	0.78
29	601988	中国银行	502,158	1,857,984.60	0.77
30	601601	中国太保	53,273	1,804,356.51	0.74
31	002304	洋河股份	20,238	1,756,860.78	0.72
32	600028	中国石化	295,399	1,751,716.07	0.72
33	600276	恒瑞医药	34,550	1,747,884.50	0.72
34	600048	保利地产	174,298	1,737,751.06	0.72
35	600019	宝钢股份	249,505	1,674,178.55	0.69
36	601006	大秦铁路	174,780	1,466,404.20	0.60
37	600010	包钢股份	664,660	1,455,605.40	0.60
38	600518	康美药业	65,920	1,433,100.80	0.59
39	600050	中国联通	183,598	1,371,477.06	0.57
40	601857	中国石油	176,957	1,360,799.33	0.56
41	601989	中国重工	214,308	1,330,852.68	0.55
42	002142	宁波银行	67,748	1,307,536.40	0.54
43	601688	华泰证券	71,784	1,284,933.60	0.53
44	601088	中国神华	57,451	1,280,582.79	0.53
45	601727	上海电气	164,309	1,243,819.13	0.51
46	000063	中兴通讯	51,614	1,225,316.36	0.50
47	600196	复星医药	38,868	1,204,519.32	0.50
48	002450	康得新	53,363	1,201,734.76	0.50
49	002252	上海莱士	57,025	1,154,186.00	0.48
50	601800	中国交建	72,049	1,144,858.61	0.47
51	601628	中国人寿	41,538	1,120,695.24	0.46
52	000776	广发证券	64,903	1,119,576.75	0.46
53	002024	苏宁云商	97,759	1,099,788.75	0.45
54	600271	航天信息	52,491	1,083,414.24	0.45
55	600023	浙能电力	196,202	1,071,262.92	0.44
56	600703	三安光电	54,371	1,071,108.70	0.44
57	600585	海螺水泥	46,916	1,066,400.68	0.44
58	601618	中国中冶	209,800	1,051,098.00	0.43
59	600690	青岛海尔	67,596	1,017,319.80	0.42
60	600795	国电电力	276,062	993,823.20	0.41
61	600111	北方稀土	84,169	953,634.77	0.39
62	600958	东方证券	68,461	952,292.51	0.39

63	600089	特变电工	91,637	946,610.21	0.39
64	601888	中国国旅	30,836	929,397.04	0.38
65	601939	建设银行	147,057	904,400.55	0.37
66	601009	南京银行	80,235	899,434.35	0.37
67	601901	方正证券	89,542	889,152.06	0.37
68	600352	浙江龙盛	91,933	876,121.49	0.36
69	600999	招商证券	50,367	867,319.74	0.36
70	600309	万华化学	30,109	862,321.76	0.36
71	600741	华域汽车	35,190	853,005.60	0.35
72	000423	东阿阿胶	11,780	846,864.20	0.35
73	000538	云南白药	8,722	818,559.70	0.34
74	601998	中信银行	129,838	816,681.02	0.34
75	601788	光大证券	54,400	812,192.00	0.33
76	601985	中国核电	103,100	805,211.00	0.33
77	600660	福耀玻璃	30,857	803,516.28	0.33
78	601669	中国电建	101,141	801,036.72	0.33
79	600009	上海机场	21,305	794,889.55	0.33
80	000338	潍柴动力	60,042	792,554.40	0.33
81	601899	紫金矿业	230,285	789,877.55	0.33
82	600066	宇通客车	35,327	776,134.19	0.32
83	601377	兴业证券	101,929	757,332.47	0.31
84	000625	长安汽车	51,962	749,292.04	0.31
85	601607	上海医药	25,791	744,844.08	0.31
86	600018	上港集团	117,168	742,845.12	0.31
87	000069	华侨城 A	73,652	740,939.12	0.31
88	601336	新华保险	14,262	733,066.80	0.30
89	002736	国信证券	53,435	708,013.75	0.29
90	600886	国投电力	89,610	707,919.00	0.29
91	002594	比亚迪	14,161	707,341.95	0.29
92	600535	天士力	16,966	704,767.64	0.29
93	000783	长江证券	72,944	690,779.68	0.28
94	600029	南方航空	78,834	685,855.80	0.28
95	600031	三一重工	84,100	683,733.00	0.28
96	600170	上海建工	175,371	669,917.22	0.28
97	600188	兖州煤业	54,120	662,428.80	0.27
98	600663	陆家嘴	27,656	653,787.84	0.27
99	000008	神州高铁	88,000	640,640.00	0.26
100	000623	吉林敖东	27,777	635,815.53	0.26
101	601600	中国铝业	140,467	634,910.84	0.26

102	600383	金地集团	55,254	633,763.38	0.26
103	600637	东方明珠	29,237	633,565.79	0.26
104	000792	盐湖股份	59,390	620,625.50	0.26
105	601099	太平洋	150,185	603,743.70	0.25
106	601933	永辉超市	84,676	599,506.08	0.25
107	600177	雅戈尔	58,944	596,513.28	0.25
108	601018	宁波港	105,421	595,628.65	0.25
109	601555	东吴证券	52,697	591,787.31	0.24
110	002241	歌尔股份	30,470	587,461.60	0.24
111	000568	泸州老窖	11,482	580,759.56	0.24
112	600893	航发动力	21,261	580,425.30	0.24
113	601633	长城汽车	43,291	575,337.39	0.24
114	002456	欧菲光	31,635	574,807.95	0.24
115	600522	中天科技	47,000	566,350.00	0.23
116	000768	中航飞机	30,636	564,927.84	0.23
117	002081	金螳螂	51,333	563,636.34	0.23
118	000876	新希望	68,314	561,541.08	0.23
119	000166	申万宏源	99,467	557,015.20	0.23
120	600705	中航资本	98,580	556,977.00	0.23
121	600649	城投控股	52,282	549,483.82	0.23
122	002475	立讯精密	18,682	546,261.68	0.23
123	000100	TCL 集团	159,066	545,596.38	0.22
124	000157	中联重科	119,018	534,390.82	0.22
125	002202	金风科技	34,514	533,931.58	0.22
126	300072	三聚环保	14,397	533,408.85	0.22
127	600100	同方股份	37,135	524,346.20	0.22
128	002470	金正大	69,600	524,088.00	0.22
129	601866	中远海发	144,878	521,560.80	0.21
130	000895	双汇发展	21,797	517,678.75	0.21
131	000983	西山煤电	58,000	508,660.00	0.21
132	600153	建发股份	38,738	500,882.34	0.21
133	600739	辽宁成大	27,749	500,314.47	0.21
134	000156	华数传媒	33,395	497,919.45	0.21
135	600221	海航控股	153,499	494,266.78	0.20
136	600827	百联股份	30,268	491,855.00	0.20
137	000959	首钢股份	70,200	490,698.00	0.20
138	601117	中国化学	68,800	480,912.00	0.20
139	600688	上海石化	71,950	475,589.50	0.20
140	600674	川投能源	48,416	475,445.12	0.20

141	600547	山东黄金	16,252	470,170.36	0.19
142	601225	陕西煤业	66,312	468,825.84	0.19
143	600208	新湖中宝	102,969	463,360.50	0.19
144	601919	中远海控	86,300	461,705.00	0.19
145	002065	东华软件	20,669	450,377.51	0.19
146	000793	华闻传媒	44,484	450,178.08	0.19
147	600362	江西铜业	26,677	449,774.22	0.19
148	600369	西南证券	79,414	445,512.54	0.18
149	600115	东方航空	65,205	443,394.00	0.18
150	600804	鹏博士	24,845	440,998.75	0.18
151	601111	中国国航	45,160	440,310.00	0.18
152	600415	小商品城	59,838	433,227.12	0.18
153	603993	洛阳钼业	85,046	430,332.76	0.18
154	600157	永泰能源	120,378	429,749.46	0.18
155	000540	中天金融	61,752	429,176.40	0.18
156	000917	电广传媒	37,882	428,066.60	0.18
157	600583	海油工程	67,107	418,747.68	0.17
158	600372	中航电子	24,073	418,148.01	0.17
159	600256	广汇能源	100,400	415,656.00	0.17
160	600820	隧道股份	41,000	414,100.00	0.17
161	600060	海信电器	27,263	413,579.71	0.17
162	002673	西部证券	29,046	413,034.12	0.17
163	300124	汇川技术	16,140	412,215.60	0.17
164	002465	海格通信	37,966	407,754.84	0.17
165	000963	华东医药	8,196	407,341.20	0.17
166	000425	徐工机械	108,292	406,095.00	0.17
167	600816	安信信托	29,240	397,371.60	0.16
168	000826	启迪桑德	11,310	397,207.20	0.16
169	601333	广深铁路	87,668	396,259.36	0.16
170	002739	万达电影	7,700	392,469.00	0.16
171	000630	铜陵有色	137,419	390,269.96	0.16
172	000060	中金岭南	34,240	383,488.00	0.16
173	600489	中金黄金	37,841	379,545.23	0.16
174	600061	国投安信	24,200	376,310.00	0.16
175	000009	中国宝安	46,380	375,214.20	0.15
176	600332	白云山	12,508	363,232.32	0.15
177	601216	君正集团	74,154	362,613.06	0.15
178	600037	歌华有线	24,800	361,088.00	0.15
179	000750	国海证券	65,057	357,813.50	0.15

180	000402	金融街	30,504	357,506.88	0.15
181	002500	山西证券	37,239	356,749.62	0.15
182	601958	金钼股份	49,434	354,441.78	0.15
183	300024	机器人	18,019	351,370.50	0.14
184	600297	广汇汽车	46,370	349,166.10	0.14
185	600150	中国船舶	15,095	345,222.65	0.14
186	002508	老板电器	7,900	343,492.00	0.14
187	002007	华兰生物	9,265	338,172.50	0.14
188	002044	美年健康	19,700	334,900.00	0.14
189	600376	首开股份	29,000	331,760.00	0.14
190	300144	宋城演艺	15,783	329,391.21	0.14
191	600085	同仁堂	9,062	316,807.52	0.13
192	601198	东兴证券	18,300	315,492.00	0.13
193	000686	东北证券	30,734	308,876.70	0.13
194	600436	片仔癀	5,000	305,200.00	0.13
195	300027	华谊兄弟	36,435	294,759.15	0.12
196	300251	光线传媒	35,640	291,891.60	0.12
197	600498	烽火通信	11,400	288,990.00	0.12
198	600895	张江高科	17,000	286,960.00	0.12
199	600373	中文传媒	12,161	285,905.11	0.12
200	002385	大北农	44,964	282,823.56	0.12
201	001979	招商蛇口	13,154	280,969.44	0.12
202	002183	怡亚通	32,400	279,612.00	0.12
203	600959	江苏有线	26,390	278,942.30	0.11
204	600118	中国卫星	9,915	276,033.60	0.11
205	000415	渤海金控	40,512	272,645.76	0.11
206	002027	分众传媒	19,700	271,072.00	0.11
207	600588	用友网络	15,564	266,455.68	0.11
208	600682	南京新百	7,200	265,680.00	0.11
209	601718	际华集团	29,000	254,910.00	0.11
210	601877	正泰电器	12,600	253,134.00	0.10
211	601872	招商轮船	48,000	247,680.00	0.10
212	600038	中直股份	5,231	239,422.87	0.10
213	600021	上海电力	18,878	228,235.02	0.09
214	002152	广电运通	26,400	219,384.00	0.09
215	002411	必康股份	7,500	216,900.00	0.09
216	600340	华夏幸福	6,452	216,658.16	0.09
217	600737	中粮糖业	22,500	212,400.00	0.09
218	600074	保千里	16,027	205,305.87	0.08

219	002714	牧原股份	7,520	204,694.40	0.08
220	000671	阳光城	35,100	204,282.00	0.08
221	000938	紫光股份	3,300	201,696.00	0.08
222	002131	利欧股份	60,950	200,525.50	0.08
223	600549	厦门钨业	9,300	199,857.00	0.08
224	000738	航发控制	10,117	197,989.69	0.08
225	600685	中船防务	7,200	197,136.00	0.08
226	000718	苏宁环球	33,600	196,896.00	0.08
227	601118	海南橡胶	34,607	196,567.76	0.08
228	002292	奥飞娱乐	11,529	194,840.10	0.08
229	300104	乐视网	6,311	193,621.48	0.08
230	300070	碧水源	10,217	190,547.05	0.08
231	002602	世纪华通	5,000	181,300.00	0.07
232	600068	葛洲坝	16,021	180,076.04	0.07
233	300059	东方财富	14,118	169,698.36	0.07
234	300133	华策影视	15,139	169,556.80	0.07
235	300168	万达信息	11,600	168,780.00	0.07
236	002230	科大讯飞	4,074	162,552.60	0.07
237	601608	中信重工	28,900	160,106.00	0.07
238	000961	中南建设	24,500	159,740.00	0.07
239	002153	石基信息	6,972	158,473.56	0.07
240	600606	绿地控股	20,000	156,400.00	0.06
241	002299	圣农发展	9,600	142,752.00	0.06
242	000413	东旭光电	12,719	142,707.18	0.06
243	600406	国电南瑞	8,041	141,923.65	0.06
244	600109	国金证券	11,718	137,334.96	0.06
245	002236	大华股份	6,015	137,202.15	0.06
246	002424	贵州百灵	7,100	133,906.00	0.06
247	002466	天齐锂业	2,300	125,005.00	0.05
248	000709	河钢股份	29,238	122,507.22	0.05
249	002008	大族激光	3,489	120,858.96	0.05
250	000728	国元证券	9,804	119,804.88	0.05
251	601992	金隅股份	17,900	115,813.00	0.05
252	000839	中信国安	11,350	113,386.50	0.05
253	000555	神州信息	6,400	106,880.00	0.04
254	000503	海虹控股	4,015	100,093.95	0.04
255	002310	东方园林	5,800	96,976.00	0.04
256	300017	网宿科技	7,908	95,449.56	0.04
257	600570	恒生电子	2,036	95,040.48	0.04

258	002146	荣盛发展	9,416	92,935.92	0.04
259	601229	上海银行	3,600	91,944.00	0.04
260	601155	新城控股	4,900	90,846.00	0.04
261	600704	物产中大	12,145	88,537.05	0.04
262	600008	首创股份	13,018	85,658.44	0.04
263	600718	东软集团	4,880	75,884.00	0.03
264	002195	二三四五	10,558	75,489.70	0.03
265	002129	中环股份	8,363	69,162.01	0.03
266	600919	江苏银行	6,900	64,101.00	0.03
267	002074	国轩高科	2,000	63,100.00	0.03
268	600485	信威集团	4,065	59,308.35	0.02
269	601997	贵阳银行	3,700	58,497.00	0.02
270	000977	浪潮信息	3,300	57,156.00	0.02
271	000627	天茂集团	7,000	56,560.00	0.02
272	600977	中国电影	3,000	56,160.00	0.02
273	300033	同花顺	900	55,989.00	0.02
274	600666	奥瑞德	3,040	52,896.00	0.02
275	600482	中国动力	1,900	48,051.00	0.02
276	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
277	002174	游族网络	1,493	47,417.68	0.02
278	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
279	300315	掌趣科技	5,603	45,720.48	0.02
280	600909	华安证券	4,400	44,396.00	0.02
281	002558	巨人网络	960	44,371.20	0.02
282	601021	春秋航空	1,300	43,719.00	0.02
283	002555	三七互娱	1,700	43,469.00	0.02
284	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
285	002352	顺丰控股	800	42,528.00	0.02
286	601881	中国银河	3,500	41,510.00	0.02
287	002426	胜利精密	5,100	39,168.00	0.02
288	600446	金证股份	2,100	36,918.00	0.02
289	601163	三角轮胎	1,300	34,190.00	0.01
290	002049	紫光国芯	1,100	33,902.00	0.01
291	601611	中国核建	2,800	33,516.00	0.01
292	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.01
293	601375	中原证券	3,300	33,198.00	0.01
294	600926	杭州银行	2,200	32,670.00	0.01
295	601966	玲珑轮胎	1,300	29,159.00	0.01
296	603858	步长制药	400	28,656.00	0.01

297	600233	圆通速递	1,300	25,467.00	0.01
298	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
299	600871	石化油服	7,400	24,716.00	0.01
300	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
301	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
302	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
303	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
304	603160	汇顶科技	200	20,060.00	0.01
305	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
306	601127	小康股份	900	17,955.00	0.01
307	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
308	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
309	002797	第一创业	1,600	14,736.00	0.01
310	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
311	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
312	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
313	002839	张家港行	800	12,576.00	0.01
314	600654	*ST 中安	900	12,132.00	0.00
315	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
316	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
317	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
318	002831	裕同科技	100	7,500.00	0.00
319	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
320	002841	视源股份	100	7,422.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	8,766,465.99	34.50
2	601668	中国建筑	5,530,397.70	21.77
3	600036	招商银行	5,364,663.44	21.11
4	601166	兴业银行	4,892,434.00	19.26
5	601818	光大银行	4,804,037.88	18.91
6	600016	民生银行	4,704,157.00	18.51
7	000002	万科A	4,348,415.20	17.11



8	600519	贵州茅台	4,303,508.00	16.94
9	601328	交通银行	4,130,096.00	16.25
10	601288	农业银行	3,751,468.00	14.76
11	600000	浦发银行	3,749,068.90	14.76
12	000333	美的集团	3,333,183.00	13.12
13	000651	格力电器	3,243,479.00	12.77
14	601169	北京银行	3,130,274.00	12.32
15	002470	金正大	2,879,979.00	11.33
16	600030	中信证券	2,868,517.00	11.29
17	600900	长江电力	2,779,829.61	10.94
18	600837	海通证券	2,738,678.00	10.78
19	601766	中国中车	2,724,018.00	10.72
20	600019	宝钢股份	2,589,449.37	10.19
21	601398	工商银行	2,528,975.00	9.95
22	600887	伊利股份	2,490,575.00	9.80
23	600104	上汽集团	2,462,598.00	9.69
24	601988	中国银行	2,410,397.00	9.49
25	600028	中国石化	2,369,953.00	9.33
26	601390	中国中铁	2,329,518.66	9.17
27	600050	中国联通	2,267,283.00	8.92
28	000001	平安银行	2,194,920.00	8.64
29	600276	恒瑞医药	2,174,994.08	8.56
30	600048	保利地产	2,103,101.00	8.28
31	600010	宝钢股份	2,049,368.00	8.07
32	002304	洋河股份	2,010,020.64	7.91
33	601186	中国铁建	1,946,126.15	7.66
34	601211	国泰君安	1,941,989.00	7.64
35	601601	中国太保	1,876,427.00	7.39
36	601857	中国石油	1,861,939.00	7.33
37	600518	康美药业	1,763,761.00	6.94
38	000725	京东方 A	1,719,395.00	6.77
39	000858	五粮液	1,697,824.00	6.68
40	601800	中国交建	1,686,560.37	6.64
41	601628	中国人寿	1,679,742.00	6.61
42	002415	海康威视	1,659,094.00	6.53
43	601989	中国重工	1,656,324.00	6.52

44	000895	双汇发展	1,628,958.50	6.41
45	600018	上港集团	1,620,259.00	6.38
46	601006	大秦铁路	1,605,739.00	6.32
47	000063	中兴通讯	1,605,558.00	6.32
48	600867	通化东宝	1,587,634.17	6.25
49	600415	小商品城	1,566,497.00	6.17
50	600177	雅戈尔	1,500,395.26	5.91
51	000008	神州高铁	1,477,128.00	5.81
52	000826	启迪桑德	1,455,014.00	5.73
53	600089	特变电工	1,454,229.00	5.72
54	000156	华数传媒	1,444,283.00	5.68
55	601088	中国神华	1,418,551.00	5.58
56	600648	外高桥	1,411,701.72	5.56
57	000538	云南白药	1,398,863.00	5.51
58	600637	东方明珠	1,371,400.06	5.40
59	002252	上海莱士	1,328,641.00	5.23
60	601985	中国核电	1,325,713.00	5.22
61	002024	苏宁云商	1,324,676.00	5.21
62	601688	华泰证券	1,317,751.00	5.19
63	601928	凤凰传媒	1,311,237.00	5.16
64	600157	永泰能源	1,298,822.00	5.11
65	600893	航发动力	1,258,403.08	4.95
66	300072	三聚环保	1,219,182.00	4.80
67	002142	宁波银行	1,217,589.00	4.79
68	600023	浙能电力	1,215,673.00	4.78
69	000069	华侨城 A	1,215,292.00	4.78
70	601099	太平洋	1,207,597.00	4.75
71	000423	东阿阿胶	1,205,104.00	4.74
72	601225	陕西煤业	1,191,463.00	4.69
73	600066	宇通客车	1,190,179.25	4.68
74	600663	陆家嘴	1,174,748.86	4.62
75	000338	潍柴动力	1,171,879.00	4.61
76	300015	爱尔眼科	1,169,552.27	4.60
77	002153	石基信息	1,158,571.91	4.56
78	002594	比亚迪	1,139,972.00	4.49
79	000776	广发证券	1,139,928.00	4.49

80	600196	复星医药	1,132,874.00	4.46
81	601618	中国中冶	1,125,261.00	4.43
82	600115	东方航空	1,124,135.00	4.42
83	601866	中远海发	1,097,057.00	4.32
84	002456	欧菲光	1,086,797.88	4.28
85	601888	中国国旅	1,067,695.00	4.20
86	600674	川投能源	1,061,618.00	4.18
87	002673	西部证券	1,046,045.30	4.12
88	600958	东方证券	1,045,962.00	4.12
89	601998	中信银行	1,045,785.50	4.12
90	600795	国电电力	1,023,635.00	4.03
91	600271	航天信息	1,021,485.74	4.02
92	601727	上海电气	1,018,828.00	4.01
93	600111	北方稀土	1,017,329.00	4.00
94	002450	康得新	1,011,543.00	3.98
95	002739	万达电影	1,003,257.08	3.95
96	600383	金地集团	995,990.00	3.92
97	600188	兖州煤业	990,576.00	3.90
98	600585	海螺水泥	987,011.00	3.88
99	000623	吉林敖东	982,335.00	3.87
100	601009	南京银行	959,025.00	3.77
101	002085	万丰奥威	958,993.00	3.77
102	601633	长城汽车	947,142.00	3.73
103	600009	上海机场	916,993.00	3.61
104	600352	浙江龙盛	913,758.70	3.60
105	601899	紫金矿业	903,167.00	3.55
106	600547	山东黄金	899,286.00	3.54
107	601018	宁波港	884,403.00	3.48
108	601216	君正集团	881,372.00	3.47
109	000402	金融街	878,051.00	3.46
110	002146	荣盛发展	876,240.00	3.45
111	000917	电广传媒	868,792.00	3.42
112	601939	建设银行	862,201.00	3.39
113	000793	华闻传媒	860,043.00	3.38
114	600340	华夏幸福	857,447.00	3.37
115	601111	中国国航	855,314.00	3.37

116	300024	机器人	848,026.00	3.34
117	000166	申万宏源	847,512.00	3.34
118	001979	招商蛇口	843,609.00	3.32
119	600999	招商证券	838,230.00	3.30
120	600875	东方电气	835,774.00	3.29
121	600085	同仁堂	833,453.00	3.28
122	600703	三安光电	833,296.12	3.28
123	601788	光大证券	829,178.00	3.26
124	601336	新华保险	828,801.00	3.26
125	002736	国信证券	823,699.00	3.24
126	601377	兴业证券	822,917.00	3.24
127	601958	金铂股份	822,826.30	3.24
128	000625	长安汽车	818,063.00	3.22
129	600208	新湖中宝	813,509.00	3.20
130	300251	光线传媒	807,184.00	3.18
131	600372	中航电子	797,594.00	3.14
132	600649	城投控股	796,694.07	3.14
133	601933	永辉超市	795,231.00	3.13
134	600535	天士力	791,134.00	3.11
135	002008	大族激光	789,047.00	3.11
136	601877	正泰电器	787,597.00	3.10
137	002236	大华股份	783,707.00	3.08
138	603993	洛阳钼业	777,792.00	3.06
139	601600	中国铝业	769,769.00	3.03
140	600690	青岛海尔	768,408.00	3.02
141	601669	中国电建	764,350.00	3.01
142	002475	立讯精密	763,042.00	3.00
143	300059	东方财富	761,164.59	3.00
144	000768	中航飞机	759,701.00	2.99
145	601901	方正证券	758,721.80	2.99
146	000783	长江证券	750,167.00	2.95
147	600688	上海石化	738,889.00	2.91
148	000963	华东医药	738,461.19	2.91
149	600489	中金黄金	732,287.00	2.88
150	600309	万华化学	731,533.00	2.88
151	000061	农产品	730,690.00	2.88

152	600583	海油工程	704,341.20	2.77
153	600170	上海建工	697,572.00	2.75
154	600150	中国船舶	666,508.00	2.62
155	000425	徐工机械	665,273.00	2.62
156	600588	用友网络	651,347.00	2.56
157	300070	碧水源	637,532.00	2.51
158	000792	盐湖股份	637,505.00	2.51
159	600705	中航资本	636,510.00	2.51
160	000503	海虹控股	635,403.00	2.50
161	600060	海信电器	632,823.00	2.49
162	600886	国投电力	630,067.00	2.48
163	000568	泸州老窖	623,203.00	2.45
164	600741	华域汽车	620,480.00	2.44
165	600031	三一重工	615,427.00	2.42
166	000100	TCL 集团	613,479.00	2.41
167	002202	金风科技	611,840.00	2.41
168	601555	东吴证券	607,114.92	2.39
169	002241	歌尔股份	606,222.00	2.39
170	600660	福耀玻璃	599,246.00	2.36
171	600029	南方航空	596,386.00	2.35
172	600373	中文传媒	588,110.00	2.31
173	002714	牧原股份	574,915.00	2.26
174	000027	深圳能源	574,765.00	2.26
175	600754	锦江股份	557,748.00	2.20
176	000750	国海证券	546,632.00	2.15
177	601607	上海医药	546,110.00	2.15
178	000157	中联重科	545,331.00	2.15
179	600522	中天科技	538,515.00	2.12
180	002081	金螳螂	537,473.00	2.12
181	000876	新希望	533,614.00	2.10
182	601919	中远海控	521,694.00	2.05
183	600376	首开股份	521,591.00	2.05
184	300017	网宿科技	514,552.00	2.03
185	600221	海航控股	514,242.00	2.02
186	600369	西南证券	513,989.00	2.02
187	601333	广深铁路	513,659.67	2.02

188	600100	同方股份	512,438.00	2.02
-----	--------	------	------------	------

#### 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	601318	中国平安	3,799,845.00	14.96
2	601668	中国建筑	2,864,528.00	11.27
3	002470	金正大	2,419,409.36	9.52
4	600519	贵州茅台	2,011,848.98	7.92
5	600867	通化东宝	1,702,363.90	6.70
6	000002	万科A	1,524,271.90	6.00
7	600648	外高桥	1,398,202.04	5.50
8	601928	凤凰传媒	1,288,605.62	5.07
9	300015	爱尔眼科	1,248,116.06	4.91
10	000895	双汇发展	1,194,120.53	4.70
11	600050	中国联通	1,185,744.00	4.67
12	600036	招商银行	1,136,256.84	4.47
13	600415	小商品城	1,123,189.00	4.42
14	000826	启迪桑德	1,119,398.02	4.41
15	002085	万丰奥威	1,063,103.02	4.18
16	000538	云南白药	1,035,334.00	4.07
17	600900	长江电力	1,019,909.80	4.01
18	600276	恒瑞医药	990,311.00	3.90
19	002153	石基信息	989,941.03	3.90
20	600018	上港集团	987,151.00	3.89
21	600019	宝钢股份	961,716.00	3.79
22	600177	雅戈尔	957,282.00	3.77
23	002146	荣盛发展	953,175.00	3.75
24	000156	华数传媒	921,063.00	3.63
25	002008	大族激光	906,494.00	3.57
26	601225	陕西煤业	889,926.00	3.50
27	600875	东方电气	875,674.64	3.45
28	600340	华夏幸福	872,537.00	3.43
29	000008	神州高铁	857,642.00	3.38
30	300072	三聚环保	833,973.30	3.28
31	600157	永泰能源	830,756.00	3.27

32	002236	大华股份	816,540.00	3.21
33	600028	中国石化	805,165.00	3.17
34	600518	康美药业	802,137.00	3.16
35	002415	海康威视	787,159.00	3.10
36	002456	欧菲光	768,492.95	3.02
37	000069	华侨城 A	768,071.00	3.02
38	601288	农业银行	761,895.00	3.00
39	601988	中国银行	747,777.00	2.94
40	000063	中兴通讯	743,711.00	2.93
41	300070	碧水源	739,801.00	2.91
42	600637	东方明珠	738,666.00	2.91
43	001979	招商蛇口	736,706.00	2.90
44	600674	川投能源	701,871.00	2.76
45	600115	东方航空	694,590.00	2.73
46	601628	中国人寿	693,196.00	2.73
47	601601	中国太保	690,176.00	2.72
48	000061	农产品	669,183.10	2.63
49	002739	万达电影	667,130.00	2.63
50	601766	中国中车	666,355.00	2.62
51	600010	包钢股份	663,191.00	2.61
52	601216	君正集团	659,107.00	2.59
53	600893	航发动力	644,690.00	2.54
54	002673	西部证券	637,115.00	2.51
55	000333	美的集团	634,862.00	2.50
56	600089	特变电工	633,045.00	2.49
57	601099	太平洋	629,467.00	2.48
58	601166	兴业银行	621,859.00	2.45
59	000402	金融街	616,955.00	2.43
60	600085	同仁堂	612,356.00	2.41
61	000651	格力电器	601,786.00	2.37
62	300059	东方财富	599,979.00	2.36
63	601866	中远海发	592,060.00	2.33
64	000027	深圳能源	591,558.40	2.33
65	600048	保利地产	589,585.00	2.32
66	600066	宇通客车	581,015.00	2.29
67	000423	东阿阿胶	576,640.00	2.27
68	601390	中国中铁	574,985.00	2.26
69	601111	中国国航	570,963.00	2.25

70	300024	机器人	568,001.00	2.24
71	600663	陆家嘴	565,500.00	2.23
72	601985	中国核电	565,482.00	2.23
73	601800	中国交建	549,633.00	2.16
74	601877	正泰电器	542,478.92	2.14
75	000338	潍柴动力	536,043.00	2.11
76	600104	上汽集团	534,832.00	2.10
77	000963	华东医药	529,002.00	2.08
78	002594	比亚迪	523,598.00	2.06
79	601857	中国石油	522,040.00	2.05
80	600754	锦江股份	517,787.00	2.04
81	601088	中国神华	513,670.00	2.02

### 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	296,453,182.65
卖出股票收入（成交）总额	112,016,930.08

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,340,453.20	2.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,340,453.20	2.61

### 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

金额单位：人民币元



序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010213	02 国债(13)	63,640	6,340,453.20	2.61

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.11.2 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投资国债期货。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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	181,477.03
2	应收证券清算款	34,347.24
3	应收股利	-
4	应收利息	48,436.77
5	应收申购款	6,766.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	271,027.34

### 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处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
浙商稳健	140	13,761.06	621,780.00	32.27%	1,304,769.00	67.73%
浙商进取	219	8,797.03	2,461.00	0.13%	1,924,089.00	99.87%
浙商沪深 300 指数分级	1,088	178,157.87	181,915,513.07	93.85%	11,920,251.06	6.15%
合计	1,447	136,619.81	182,539,754.07	92.34%	15,149,109.06	7.66%

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

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

浙商稳健

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	民生通惠资产—中信银行—民生通惠聚利 3 号资产管理产品	300,000.00	15.57%
2	郑志坤	235,337.00	12.22%
3	梁小红	172,840.00	8.97%
4	中融国际信托有限公司—中融—融晨 3 号证券投资集合资金信托	115,800.00	6.01%
5	海通资管—建行—海通海蓝宝润集合资产管理计划	100,000.00	5.19%
6	北京天演资本管理有限公司—星辰之天演 2 号私募证券投资基金	98,990.00	5.14%
7	徐国飞	84,300.00	4.38%
8	马仲华	82,400.00	4.28%
9	潘苏英	61,000.00	3.17%
10	杜蕾梅	60,167.00	3.12%

浙商进取

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
----	-------	---------	----------

1	左慧玲	234,669.00	12.18%
2	黎明星	222,900.00	11.57%
3	刘晓亮	207,822.00	10.79%
4	周锐	150,000.00	7.79%
5	李红	113,000.00	5.87%
6	刘巍	83,400.00	4.33%
7	王素珍	70,900.00	3.68%
8	高小涛	40,000.00	2.08%
9	邓广	31,200.00	1.62%
10	李宝库	30,900.00	1.60%

### 8.3 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	浙商稳健	-	-
	浙商进取	-	-
	浙商沪深 300 指数分级	8.41	0.00%
	合计	8.41	0.00%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	浙商稳健	0
	浙商进取	0
	浙商沪深 300 指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	浙商稳健	0
	浙商进取	0
	浙商沪深 300 指数分级	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浙商稳健	浙商进取	浙商沪深 300 指数分级
基金合同生效日（2012 年 5 月 7 日） 基金份额总额	9,136,705.00	9,136,706.00	336,090,191.17
本报告期期初基金份额总额	2,231,222.00	2,231,223.00	18,086,908.17
本报告期基金总申购份额	80,157.00	80,157.00	178,068,209.16
减:本报告期基金总赎回份额	384,830.00	384,830.00	2,319,353.20
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	1,926,549.00	1,926,550.00	193,835,764.13

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 2 月 15 日，唐生林先生就任浙商基金管理有限公司副总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 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、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
上海证券	1	268,371,963.49	66.01%	249,935.98	64.42%	-

招商证券	1	136,236,334.74	33.51%	136,239.14	35.11%	-
国都证券	1	1,960,065.16	0.48%	1,825.42	0.47%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
上海证券	6,370,364.00	100.00%	20,000,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

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、本期内本基金券商交易单元变更情况：

- (1) 租用券商交易单元未发生变动。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浙商基金 2016 年度最后一个交易日基金资产净值等公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 3 日
2	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之浙商稳健份额 2017 年度约定年基准收益率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 3 日
3	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间浙商稳健份额停复牌的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 4 日
4	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金定期折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 5 日
5	关于浙商稳健定期份额折算后次日收盘价调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 5 日
6	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金定期折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 5 日
7	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 20 日
8	2016 年 12 月董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 2 月 17 日
9	浙商基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 2 月 17 日
10	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金限制大额申购及定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 2 月 20 日
11	浙商基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道费率优惠公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 2 月 23 日
12	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 31 日
13	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 31 日



14	浙商基金旗下部分基金参与中国工商银行开展的电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 1 日
15	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 21 日
16	浙商基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 22 日
17	浙商基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施相关风险的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 25 日
18	浙商基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施相关风险的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 26 日
19	浙商基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施相关风险的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 27 日
20	浙商基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施相关风险的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 28 日
21	浙商基金管理有限公司关于新增上海通华财富资产管理有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 12 日
22	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要 2017 年第 1 期	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 16 日
23	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书 2017 年第 1 期	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 16 日
24	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 26 日
25	浙商基金关于机房改造暂停系统服务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 30 日
26	浙商基金管理有限公司关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 30 日

## § 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

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	2017-02-20 至 2017-06-30	0.00	70,421,654.93	0.00	70,421,654.93	35.62%
	2	2017-02-20 至 2017-06-30	0.00	61,618,838.03	0.00	61,618,838.03	31.17%
	3	2017-02-20 至 2017-06-30	0.00	44,013,204.23	0.00	44,013,204.23	22.26%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>(1) 赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>(3) 提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算。</p> <p>(4) 基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

-
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

浙江省杭州市西湖区教工路 18 号世贸丽晶城欧美中心 B 座 507 室

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.zsfund.com](http://www.zsfund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-067-9908/021-60359000 查询相关信息。

浙商基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日