

# 浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 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：华夏银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 23 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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	上市契约型开放式 (LOF)		
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	76,488,795.00 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	1,492,549.00 份	1,492,550.00 份	73,503,696.00 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%。

	<p>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。</p>		
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%</p>		
风险收益特征	<p>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。</p>		
下属分级基金的风险收益特征	<p>浙商稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征。</p>	<p>浙商进取份额具有高风险、高预期收益的特征。</p>	<p>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。</p>

### 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

## 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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	42,755,502.12	-2,506,195.20	26,584,798.01
本期利润	52,682,157.05	-4,999,572.91	4,734,245.30
加权平均基金份额本期利润	0.3239	-0.1036	0.1133
本期加权平均净值利润率	26.21%	-9.47%	8.32%
本期基金份额净值增长率	25.25%	-10.41%	4.44%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	38,376,703.09	5,104,390.50	17,273,839.22
期末可供分配基金份额利润	0.5017	0.2264	0.3642
期末基金资产净值	105,894,639.26	25,408,312.21	61,041,876.37
期末基金份额净值	1.384	1.127	1.287
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	56.56%	25.00%	39.39%

#### 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

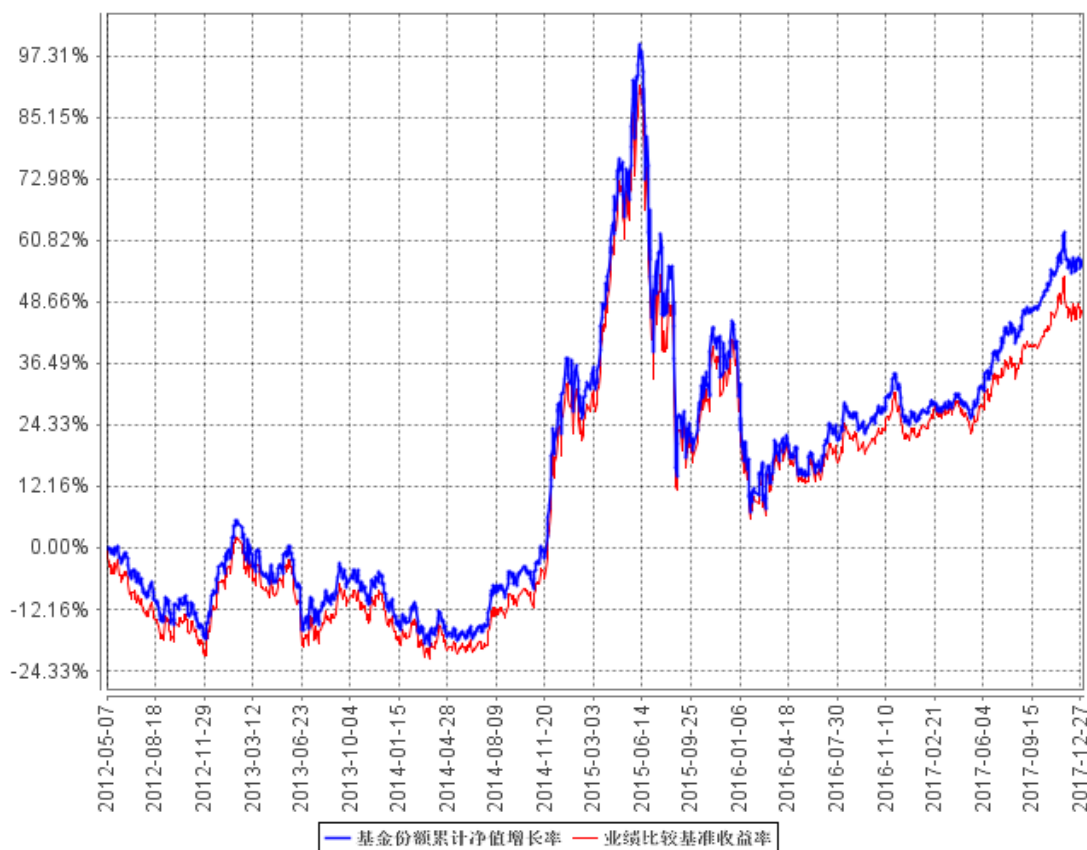
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.81%	0.66%	4.83%	0.76%	0.98%	-0.10%
过去六个月	12.80%	0.59%	9.45%	0.67%	3.35%	-0.08%
过去一年	25.31%	0.55%	20.65%	0.61%	4.66%	-0.06%
过去三年	17.34%	1.61%	14.02%	1.60%	3.32%	0.01%
过去五年	62.45%	1.47%	57.46%	1.47%	4.99%	0.00%
自基金合同生效起至今	56.60%	1.42%	46.93%	1.43%	9.67%	-0.01%

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

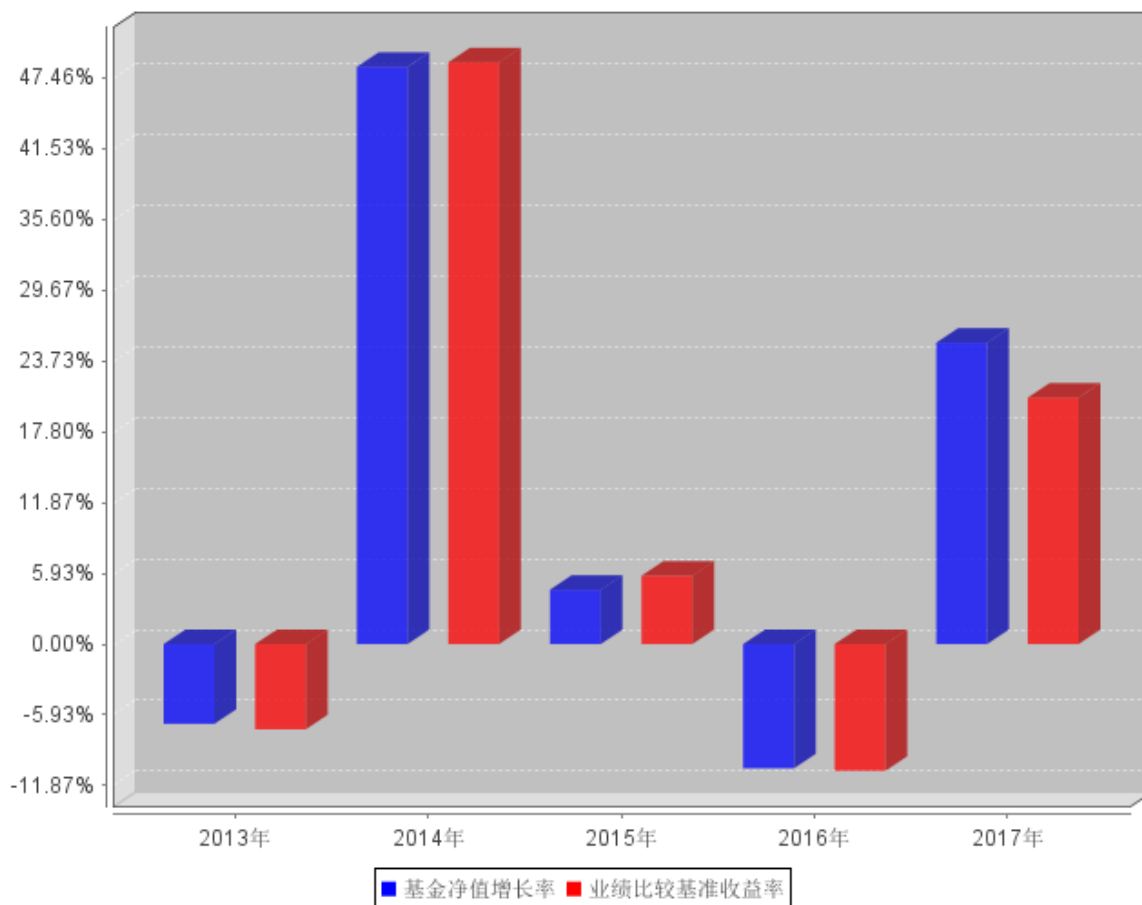


注：1、本基金基金合同生效日为 2012 年 5 月 7 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间已满一年。

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。

### 3.2.3 过去五年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

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 95\% + \text{金融同业存款利率} \times 5\%$ 。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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过往三年本基金未进行利润分配。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浙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 7,500 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 12 月 31 日,浙商基金共管理十六只开放式基金——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、浙商聚盈纯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、浙商全景消费混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	-	7	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

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 1.384 元;本报告期基金份额净值增长率为 25.31%,业绩比较基准收益率为 20.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济继续表现出较强的韧性。具体看，投资增速持续下滑的趋势有所放缓，逐步进入平稳状态。其中，房地产销售增速在 2018 年大概率会下降，同时，融资环境的恶化可能对地产投资造成一定的负面影响。制造业投资，虽然统计局制造业投资的数据没有显示出积极的迹象，但上市公司层面，我们观察到一批企业及细分行业的资本已经开始显著回升，微观层面的证据强于宏观层面。随着 ROE 从最低点的回升并维持一段时间，我们有可能看到制造业的投资进一步回暖。基建投资方面，最大的制约因素仍是各地方政府的财务状况。分地区看，我们看到多数省份的财务盈余情况承受明显压力，且从时间维度看，统计结果也显示地方政府的收入对支出的约束力也明显上升。综合看，经济中投资的增速有可能出现一定程度的下滑，但总体下滑幅度可控，具有一定的韧性。出口则在全球经济复苏的情况下，可能还会维持 2017 年较好的情况。

对于市场，流动性仍是中短期的核心影响因素。在金融监管力度持续加强的情况下，流动性总体处于平衡偏紧的状况，但也不会发生流动性危机。因此，估值在 2018 年可能成为较为次要的因素，盈利增长以及增长的质量，将会是市场最为主要的影响变量。

#### 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

本报告期内本基金存在连续二十个工作日基金资产净值少于 5,000 万元的情形。

## § 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 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 1800213 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	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 33 页的浙商沪深 300 指数分级证券投资基金（以下简称“浙商沪深 300 基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的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、在财务报表附注 2 中所列示的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，公允反映了浙商沪深 300 基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于浙商沪深 300 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>浙商沪深 300 基金管理人浙商基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括浙商沪深 300 基金 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>浙商沪深 300 基金管理人浙商基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、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，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，浙商沪深 300 基金管理人浙商基金管理有限公司管理层负责评估浙商沪深 300 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非浙商沪深 300 基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>浙商沪深 300 基金管理人浙商基金管理有限公司治理层负责监督浙商沪深 300 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价浙商沪深 300 基金管理人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及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对浙商沪深 300 基金管理人浙商基金管理有限公司管理层使</p>

	<p>用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对浙商沪深 300 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致浙商沪深 300 基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>
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）
注册会计师的姓名	黄小熠   叶凯韵
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	2018 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	7,552,458.91	1,367,472.76
结算备付金		229,145.44	57,644.89
存出保证金		169,130.64	11,395.59
交易性金融资产	7.4.7.2	98,411,423.84	24,270,702.29
其中：股票投资		98,411,423.84	24,270,702.29
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		250,331.17	-
应收利息	7.4.7.5	1,661.25	373.66
应收股利		-	-
应收申购款		2,854.60	1,237.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		106,617,005.85	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 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>



<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		25.27	25.27
应付赎回款		10,525.53	737.73
应付管理人报酬		89,652.60	32,560.81
应付托管费		19,723.59	7,163.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	306,201.21	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	7.4.7.8	296,238.39	205,602.75
负债合计		722,366.59	300,514.90
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	67,517,936.17	20,303,921.71
未分配利润	7.4.7.10	38,376,703.09	5,104,390.50
所有者权益合计		105,894,639.26	25,408,312.21
负债和所有者权益总计		106,617,005.85	25,708,827.11

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.384 元，基金份额总额 76,488,795.00 份。本基金浙商稳健份额净值为 1.045 元，份额总额 1,492,549.00 份；浙商进取份额净值为 1.723 元，份额总额 1,492,550.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		56,873,526.73	-3,697,510.96
1. 利息收入		185,625.94	26,827.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	86,263.42	26,827.92
债券利息收入		90,665.23	-
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）		46,545,551.42	-1,265,859.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	42,223,804.42	-2,384,489.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-6,364.00	-
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	4,328,111.00	1,118,630.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	9,926,654.93	-2,493,377.71
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	215,694.44	34,897.94
<b>减：二、费用</b>		4,191,369.68	1,302,061.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,982,106.92	531,023.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	436,063.57	116,825.21
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,307,599.19	199,213.24

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	465,600.00	455,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		52,682,157.05	-4,999,572.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		52,682,157.05	-4,999,572.91

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	52,682,157.05	52,682,157.05
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）	47,214,014.46	-19,409,844.46	27,804,170.00
其中：1. 基金申购款	157,435,237.40	45,424,198.54	202,859,435.94
2. 基金赎回款	-110,221,222.94	-64,834,043.00	-175,055,265.94
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）	67,517,936.17	38,376,703.09	105,894,639.26
项目	上年度可比期间		
	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）	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）	-	-4,999,572.91	-4,999,572.91
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）	-23,464,115.44	-7,169,875.81	-30,633,991.25
其中：1. 基金申购款	11,132,736.95	1,812,597.38	12,945,334.33
2. 基金赎回款	-34,596,852.39	-8,982,473.19	-43,579,325.58
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）	20,303,921.71	5,104,390.50	25,408,312.21

注：报表附注为财务报表的组成部分。

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：

\_\_\_\_\_  
聂挺进

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
唐生林

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
唐生林

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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》发售，基金合同于 2012 年 5 月 7 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 354,363,602.17 份基金份额。本基金的基金管理人为浙商基金管理有限公司，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 份基金份额于 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%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×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

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及附注 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的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况、2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

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

##### 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。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足

证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生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，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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。

#### 7.4.4.8 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，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日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（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。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。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

#### 7.4.4.10 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。

本基金的交易费用用于进行股票、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。

#### 7.4.4.11 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。经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止浙商稳健份额与浙商进取份额的

运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配原则。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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

根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》附件《证券投资基金投资流通受限股票估值业务指引（试行）》（以下简称“估值指引”）的处理标准，本基金自2017年12月27日起，对本基金持有的估值指引所称流通受限股票的估值方法进行调整，参考估值指引进行估值。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财税 [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 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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) 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。

(b) 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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应

纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

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

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

#### 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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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。

###### 7.4.8.1.2 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。

###### 7.4.8.1.3 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。

###### 7.4.8.1.4 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。

###### 7.4.8.1.5 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。

## 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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,982,106.92	531,023.50
其中：支付销售机构的客户维护费	68,458.70	66,865.22

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。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	436,063.57	116,825.21

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。

### 7.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

### 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。

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

份额单位：份

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	2,823,406.03
期间申购/买入总份 额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	57,033.65
减：期间赎回/卖出总 份额	-	-	-
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	-	-	3.77%

项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	2,755,230.81
期间申购/买入总份 额	-	-	-

期间因拆分变动份额	-	-	68,175.22
减：期间赎回/卖出总 份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	2,823,406.03
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	12.52%

#### 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

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。

#### 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有 限公司	7,552,458.91	73,778.40	1,367,472.76	25,785.85

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。

本基金通过“华夏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2017年12月31日的相关余额为人民币229,145.44元（2016年12月31日：人民币57,644.89元）。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及去年同期均未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

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。

### 7.4.10 期末（2017 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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	备注
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

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。

#### 7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002470	金正大	2017 年 10 月 25 日	筹划重大事项	9.15	2018 年 2 月 9 日	8.24	243,600	1,883,208.69	2,228,940.00	-
600157	永泰能源	2017 年 11 月	筹划重大资产	3.36	-	-	168,778	621,575.03	567,094.08	-



		21 日	重组							
600332	白云山	2017 年 10 月 31 日	筹划重大资产重组	32.14	2018 年 1 月 8 日	30.15	12,608	326,060.83	405,221.12	-
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	筹划重大资产重组	52.04	-	-	7,700	431,378.96	400,708.00	-
600150	中国船舶	2017 年 9 月 27 日	筹划重大资产重组	24.67	2018 年 3 月 21 日	22.20	7,595	184,753.13	187,368.65	-
601600	中国铝业	2017 年 9 月 12 日	筹划重大资产重组	8.09	2018 年 2 月 26 日	7.28	18,467	92,669.26	149,398.03	-
601216	君正集团	2017 年 12 月 15 日	筹划重大资产重组	4.71	-	-	27,954	143,408.75	131,663.34	-
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	筹划重大资产重组	7.35	-	-	15,452	102,028.57	113,572.20	-
600685	中船防务	2017 年 9 月 27 日	筹划重大资产重组	26.66	2018 年 3 月 21 日	24.05	3,600	102,428.76	95,976.00	-
600309	万华化学	2017 年 12 月 5 日	筹划重大资产重组	37.94	-	-	1,809	44,786.72	68,633.46	-

600485	信威集团	2016年 12月 26日	筹划重 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	筹划重 大资产 重组	17.40	-	-	3,040	55,438.91	52,896.00	-
300104	乐视网	2017年 4月17 日	筹划重 大资产 重组	3.89	2018 年1 月24 日	13.80	12,622	251,859.53	49,099.58	-
300730	科创信息	2017年 12月 25日	股票价 格涨幅 较大	41.55	2018 年1 月2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年 12月 28日	股票价 格涨幅 较大	35.26	2018 年1 月2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：截至本报告批准报出日，“永泰能源、万达电影、君正集团、中天金融、万华化学、信威集团、奥瑞德”仍未复牌。

#### 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

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。

##### 7.4.10.3.2 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。

#### 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	权益投资	98,411,423.84	92.30
	其中：股票	98,411,423.84	92.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,781,604.35	7.30
8	其他各项资产	423,977.66	0.40
9	合计	106,617,005.85	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	138,370.05	0.13
B	采矿业	4,118,486.42	3.89
C	制造业	33,470,243.83	31.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供	3,983,072.83	3.76

	应业		
E	建筑业	5,609,515.77	5.30
F	批发和零售业	2,320,844.25	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	3,989,721.89	3.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,212,136.01	2.09
J	金融业	34,753,421.60	32.82
K	房地产业	4,510,638.27	4.26
L	租赁和商务服务业	1,137,858.20	1.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	533,830.97	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	212,685.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	874,433.34	0.83
S	综合	162,562.40	0.15
	合计	98,027,820.83	92.57

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	796,516	4,946,364.36	4.67
2	601318	中国平安	68,728	4,809,585.44	4.54
3	600036	招商银行	91,194	2,646,449.88	2.50
4	600519	贵州茅台	3,377	2,355,423.73	2.22
5	002470	金正大	243,600	2,228,940.00	2.10

6	000333	美的集团	38,359	2,126,239.37	2.01
7	600000	浦发银行	152,200	1,916,198.00	1.81
8	601818	光大银行	459,908	1,862,627.40	1.76
9	601166	兴业银行	106,645	1,811,898.55	1.71
10	000651	格力电器	40,098	1,752,282.60	1.65
11	600016	民生银行	190,315	1,596,742.85	1.51
12	601169	北京银行	217,162	1,552,708.30	1.47
13	601288	农业银行	363,108	1,390,703.64	1.31
14	600887	伊利股份	41,148	1,324,554.12	1.25
15	601398	工商银行	186,702	1,157,552.40	1.09
16	601668	中国建筑	128,146	1,155,876.92	1.09
17	600104	上汽集团	32,817	1,051,456.68	0.99
18	000858	五 粮 液	12,496	998,180.48	0.94
19	600900	长江电力	61,439	957,834.01	0.90
20	002415	海康威视	24,412	952,068.00	0.90
21	601006	大秦铁路	101,680	922,237.60	0.87
22	600837	海通证券	68,609	882,997.83	0.83
23	601988	中国银行	221,558	879,585.26	0.83
24	601601	中国太保	20,473	847,991.66	0.80
25	600028	中国石化	133,699	819,574.87	0.77
26	600048	保利地产	56,498	799,446.70	0.75
27	601766	中国中车	64,819	784,958.09	0.74
28	600011	华能国际	115,700	713,869.00	0.67
29	601186	中国铁建	63,264	704,760.96	0.67
30	600019	宝钢股份	76,705	662,731.20	0.63
31	600276	恒瑞医药	9,450	651,861.00	0.62
32	000157	中联重科	145,018	648,230.46	0.61
33	000002	万 科 A	20,700	642,942.00	0.61

34	601390	中国中铁	74,461	624,727.79	0.59
35	601618	中国中冶	127,000	614,680.00	0.58
36	600221	海航控股	192,099	612,795.81	0.58
37	600518	康美药业	27,220	608,639.20	0.57
38	002142	宁波银行	34,173	608,621.13	0.57
39	600583	海油工程	98,107	603,358.05	0.57
40	601211	国泰君安	30,800	570,416.00	0.54
41	600157	永泰能源	168,778	567,094.08	0.54
42	600066	宇通客车	21,427	515,747.89	0.49
43	600959	江苏有线	62,190	508,714.20	0.48
44	600690	青岛海尔	26,296	495,416.64	0.47
45	000625	长安汽车	38,762	488,401.20	0.46
46	002594	比亚迪	7,461	485,338.05	0.46
47	002304	洋河股份	4,138	475,870.00	0.45
48	600688	上海石化	74,150	469,369.50	0.44
49	600795	国电电力	146,762	457,897.44	0.43
50	601989	中国重工	75,608	455,916.24	0.43
51	601088	中国神华	19,551	452,996.67	0.43
52	600703	三安光电	17,751	450,697.89	0.43
53	600170	上海建工	119,971	446,292.12	0.42
54	000001	平安银行	33,478	445,257.40	0.42
55	600177	雅戈尔	47,644	436,895.48	0.41
56	601688	华泰证券	24,284	419,141.84	0.40
57	601857	中国石油	51,157	413,860.13	0.39
58	002027	分众传媒	28,980	408,038.40	0.39
59	601009	南京银行	52,429	405,800.46	0.38
60	600332	白云山	12,608	405,221.12	0.38
61	600061	国投资本	30,700	404,626.00	0.38

62	000776	广发证券	24,203	403,706.04	0.38
63	002739	万达电影	7,700	400,708.00	0.38
64	600741	华域汽车	13,290	394,580.10	0.37
65	000538	云南白药	3,822	389,041.38	0.37
66	600153	建发股份	34,938	388,510.56	0.37
67	002450	康得新	17,263	383,238.60	0.36
68	601985	中国核电	52,000	382,200.00	0.36
69	600919	江苏银行	51,800	380,730.00	0.36
70	600674	川投能源	37,116	377,840.88	0.36
71	601899	紫金矿业	81,385	373,557.15	0.35
72	001979	招商蛇口	19,054	372,696.24	0.35
73	600535	天士力	10,366	368,822.28	0.35
74	600637	东方明珠	21,768	362,654.88	0.34
75	601800	中国交建	28,149	360,307.20	0.34
76	600009	上海机场	7,905	355,804.05	0.34
77	000402	金融街	32,004	355,564.44	0.34
78	600704	物产中大	51,945	354,264.90	0.33
79	600029	南方航空	29,634	353,237.28	0.33
80	601628	中国人寿	11,538	351,332.10	0.33
81	600089	特变电工	35,337	350,189.67	0.33
82	600196	复星医药	7,868	350,126.00	0.33
83	000738	航发控制	22,817	348,871.93	0.33
84	600663	陆家嘴	18,055	343,586.65	0.32
85	601669	中国电建	46,641	336,748.02	0.32
86	600415	小商品城	57,438	331,991.64	0.31
87	600660	福耀玻璃	11,357	329,353.00	0.31
88	601727	上海电气	48,809	326,532.21	0.31
89	601788	光大证券	24,200	325,006.00	0.31

90	600958	东方证券	23,361	323,783.46	0.31
91	000568	泸州老窖	4,882	322,212.00	0.30
92	600999	招商证券	18,467	316,893.72	0.30
93	600886	国投电力	43,110	316,427.40	0.30
94	002202	金风科技	16,438	309,856.30	0.29
95	601888	中国国旅	7,136	309,631.04	0.29
96	000959	首钢股份	51,500	307,970.00	0.29
97	600820	隧道股份	36,100	301,796.00	0.28
98	000166	申万宏源	53,267	286,043.79	0.27
99	000413	东旭光电	30,319	284,392.22	0.27
100	601872	招商轮船	64,600	283,594.00	0.27
101	600682	南京新百	7,500	283,425.00	0.27
102	600030	中信证券	15,569	281,798.90	0.27
103	600023	浙能电力	52,402	279,302.66	0.26
104	600208	新湖中宝	52,969	276,498.18	0.26
105	000069	华侨城 A	32,352	274,668.48	0.26
106	601377	兴业证券	37,729	274,667.12	0.26
107	000963	华东医药	5,096	274,572.48	0.26
108	600085	同仁堂	8,262	266,366.88	0.25
109	600068	葛洲坝	32,021	262,572.20	0.25
110	601901	方正证券	38,042	262,109.38	0.25
111	600050	中国联通	40,198	254,453.34	0.24
112	600115	东方航空	30,405	249,625.05	0.24
113	600383	金地集团	19,654	248,230.02	0.23
114	002024	苏宁云商	20,059	246,525.11	0.23
115	000895	双汇发展	9,297	246,370.50	0.23
116	002252	上海莱士	12,125	240,681.25	0.23
117	600018	上港集团	35,568	236,527.20	0.22



118	000423	东阿阿胶	3,880	233,847.60	0.22
119	300124	汇川技术	8,040	233,320.80	0.22
120	601607	上海医药	9,492	229,611.48	0.22
121	002007	华兰生物	8,534	229,393.92	0.22
122	000783	长江证券	28,944	227,789.28	0.22
123	600219	南山铝业	61,300	225,584.00	0.21
124	002475	立讯精密	9,523	223,219.12	0.21
125	002736	国信证券	20,135	218,464.75	0.21
126	600021	上海电力	23,878	218,244.92	0.21
127	002508	老板电器	4,500	216,450.00	0.20
128	601919	中远海控	31,100	210,547.00	0.20
129	601998	中信银行	33,838	209,795.60	0.20
130	600705	中航资本	37,080	204,681.60	0.19
131	600376	首开股份	21,700	201,593.00	0.19
132	601111	中国国航	16,360	201,555.20	0.19
133	002310	东方园林	9,900	199,683.00	0.19
134	002081	金螳螂	12,833	196,601.56	0.19
135	600406	国电南瑞	10,741	196,345.48	0.19
136	601991	大唐发电	46,400	192,560.00	0.18
137	600547	山东黄金	6,052	188,701.36	0.18
138	600150	中国船舶	7,595	187,368.65	0.18
139	600804	鹏博士	10,945	186,393.35	0.18
140	000876	新希望	24,714	184,119.30	0.17
141	002294	信立泰	4,000	180,760.00	0.17
142	600188	兖州煤业	12,220	177,434.40	0.17
143	600739	辽宁成大	10,049	176,862.40	0.17
144	601018	宁波港	33,021	175,341.51	0.17
145	600340	华夏幸福	5,552	174,277.28	0.16

146	601117	中国化学	25,700	173,475.00	0.16
147	000961	中南建设	26,900	172,429.00	0.16
148	600109	国金证券	17,424	166,224.96	0.16
149	600010	包钢股份	67,260	165,459.60	0.16
150	002572	索菲亚	4,477	164,753.60	0.16
151	600895	张江高科	11,368	162,562.40	0.15
152	600118	中国卫星	6,315	159,453.75	0.15
153	002465	海格通信	16,566	158,867.94	0.15
154	601336	新华保险	2,262	158,792.40	0.15
155	600297	广汇汽车	19,670	157,753.40	0.15
156	601633	长城汽车	13,591	156,160.59	0.15
157	000060	中金岭南	13,540	151,241.80	0.14
158	300003	乐普医疗	6,200	149,792.00	0.14
159	600893	航发动力	5,561	149,646.51	0.14
160	601600	中国铝业	18,467	149,398.03	0.14
161	601163	三角轮胎	7,300	148,774.00	0.14
162	000425	徐工机械	31,992	148,122.96	0.14
163	002602	世纪华通	4,300	146,114.00	0.14
164	600436	片仔癀	2,300	145,360.00	0.14
165	600827	百联股份	10,668	143,911.32	0.14
166	601225	陕西煤业	17,512	142,897.92	0.13
167	601555	东吴证券	14,697	142,854.84	0.13
168	000725	京东方 A	24,247	140,390.13	0.13
169	000826	启迪桑德	4,210	139,014.20	0.13
170	002146	荣盛发展	14,416	137,384.48	0.13
171	002624	完美世界	4,100	137,186.00	0.13
172	300024	机器人	7,219	135,861.58	0.13
173	601866	中远海发	39,778	135,642.98	0.13

174	600649	城投控股	15,382	135,361.60	0.13
175	601898	中煤能源	23,600	134,992.00	0.13
176	002426	胜利精密	23,100	134,673.00	0.13
177	002385	大北农	22,164	134,313.84	0.13
178	600100	同方股份	13,535	132,643.00	0.13
179	601216	君正集团	27,954	131,663.34	0.12
180	002065	东华软件	15,638	128,231.60	0.12
181	601333	广深铁路	22,868	127,374.76	0.12
182	000709	河钢股份	32,638	127,288.20	0.12
183	600585	海螺水泥	4,316	126,588.28	0.12
184	601099	太平洋	33,485	121,215.70	0.11
185	002044	美年健康	5,500	120,285.00	0.11
186	300070	碧水源	6,917	120,148.29	0.11
187	300027	华谊兄弟	13,735	119,906.55	0.11
188	600482	中国动力	4,800	119,088.00	0.11
189	601939	建设银行	15,457	118,709.76	0.11
190	000898	鞍钢股份	18,500	117,475.00	0.11
191	600606	绿地控股	15,700	114,610.00	0.11
192	300144	宋城演艺	6,091	113,658.06	0.11
193	000540	中天金融	15,452	113,572.20	0.11
194	300072	三聚环保	3,197	112,310.61	0.11
195	000768	中航飞机	6,636	112,082.04	0.11
196	000008	神州高铁	12,700	111,125.00	0.10
197	601608	中信重工	26,100	107,532.00	0.10
198	601229	上海银行	7,500	106,350.00	0.10
199	601198	东兴证券	7,300	105,120.00	0.10
200	000671	阳光城	13,000	102,310.00	0.10
201	300315	掌趣科技	17,803	98,984.68	0.09

202	600685	中船防务	3,600	95,976.00	0.09
203	601877	正泰电器	3,600	94,140.00	0.09
204	600372	中航电子	6,873	94,091.37	0.09
205	300015	爱尔眼科	3,000	92,400.00	0.09
206	600362	江西铜业	4,577	92,318.09	0.09
207	000338	潍柴动力	10,884	90,772.56	0.09
208	000630	铜陵有色	30,719	89,699.48	0.08
209	600816	安信信托	6,840	89,467.20	0.08
210	000750	国海证券	18,157	88,969.30	0.08
211	000415	渤海金控	15,312	88,197.12	0.08
212	600977	中国电影	5,600	86,240.00	0.08
213	600489	中金黄金	8,541	84,470.49	0.08
214	600031	三一重工	9,300	84,351.00	0.08
215	601992	金隅股份	15,400	83,622.00	0.08
216	600373	中文传媒	4,561	77,217.73	0.07
217	300251	光线传媒	7,340	76,703.00	0.07
218	000686	东北证券	8,634	75,720.18	0.07
219	002714	牧原股份	1,420	75,061.20	0.07
220	600352	浙江龙盛	6,133	71,817.43	0.07
221	002468	申通快递	2,900	71,601.00	0.07
222	000063	中兴通讯	1,914	69,593.04	0.07
223	002411	必康股份	2,600	69,342.00	0.07
224	002241	歌尔股份	3,970	68,879.50	0.07
225	600309	万华化学	1,809	68,633.46	0.06
226	000100	TCL 集团	17,566	68,507.40	0.06
227	000728	国元证券	6,204	68,244.00	0.06
228	601933	永辉超市	6,476	65,407.60	0.06
229	600369	西南证券	13,914	64,421.82	0.06

230	000723	美锦能源	9,300	64,077.00	0.06
231	601958	金钼股份	8,834	63,869.82	0.06
232	601118	海南橡胶	11,407	63,308.85	0.06
233	601966	玲珑轮胎	3,600	62,856.00	0.06
234	600522	中天科技	4,400	61,336.00	0.06
235	002074	国轩高科	2,700	60,102.00	0.06
236	601611	中国核建	5,800	59,566.00	0.06
237	603993	洛阳钼业	8,646	59,484.48	0.06
238	600485	信威集团	4,065	59,308.35	0.06
239	600038	中直股份	1,231	57,278.43	0.05
240	601155	新城控股	1,900	55,670.00	0.05
241	601718	际华集团	8,200	55,186.00	0.05
242	002292	奥飞娱乐	3,829	54,716.41	0.05
243	002558	巨人网络	1,460	53,728.00	0.05
244	600271	航天信息	2,391	51,502.14	0.05
245	300104	乐视网	12,622	49,099.58	0.05
246	002608	江苏国信	4,800	48,768.00	0.05
247	000623	吉林敖东	1,977	44,482.50	0.04
248	002673	西部证券	3,446	42,454.72	0.04
249	002236	大华股份	1,815	41,908.35	0.04
250	600074	ST 保千里	4,127	40,733.49	0.04
251	601997	贵阳银行	3,000	40,080.00	0.04
252	002500	山西证券	4,239	39,083.58	0.04
253	002008	大族激光	789	38,976.60	0.04
254	002424	贵州百灵	2,500	38,500.00	0.04
255	600008	首创股份	7,418	38,128.52	0.04
256	600498	烽火通信	1,200	34,596.00	0.03
257	600926	杭州银行	3,000	34,590.00	0.03

258	002230	科大讯飞	574	33,946.36	0.03
259	002466	天齐锂业	600	31,926.00	0.03
260	002456	欧菲科技	1,535	31,605.65	0.03
261	600588	用友网络	1,464	30,963.60	0.03
262	300122	智飞生物	1,100	30,877.00	0.03
263	300033	同花顺	600	29,988.00	0.03
264	002460	赣锋锂业	400	28,700.00	0.03
265	002555	三七互娱	1,300	26,702.00	0.03
266	603858	步长制药	500	25,430.00	0.02
267	300136	信维通信	500	25,350.00	0.02
268	300059	东方财富	1,918	24,838.10	0.02
269	000627	天茂集团	3,100	24,800.00	0.02
270	601021	春秋航空	635	23,666.45	0.02
271	600909	华安证券	3,200	23,264.00	0.02
272	002601	龙蟠佰利	1,400	22,428.00	0.02
273	000938	紫光股份	300	21,609.00	0.02
274	600233	圆通速递	1,200	20,100.00	0.02
275	600111	北方稀土	1,369	19,973.71	0.02
276	603160	汇顶科技	200	19,388.00	0.02
277	600871	石化油服	7,100	18,957.00	0.02
278	000503	海虹控股	415	17,911.40	0.02
279	000983	西山煤电	1,700	17,238.00	0.02
280	000839	中信国安	1,750	16,782.50	0.02
281	002831	裕同科技	300	16,764.00	0.02
282	300017	网宿科技	1,508	16,045.12	0.02
283	600570	恒生电子	336	15,590.40	0.01
284	600549	厦门钨业	500	12,870.00	0.01
285	002153	石基信息	472	12,583.52	0.01

286	000792	盐湖股份	890	12,379.90	0.01
287	002174	游族网络	493	10,993.90	0.01
288	002352	顺丰控股	200	10,072.00	0.01
289	002797	第一创业	900	8,820.00	0.01
290	601881	中国银河	700	7,357.00	0.01
291	002841	视源股份	100	7,250.00	0.01
292	601375	中原证券	400	2,468.00	0.00
293	002839	张家港行	200	2,344.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	8,883,920.99	34.96
2	601818	光大银行	8,711,061.88	34.28
3	601328	交通银行	7,843,877.00	30.87
4	601668	中国建筑	6,979,040.70	27.47
5	600036	招商银行	6,686,534.49	26.32
6	000651	格力电器	5,568,267.00	21.92
7	601166	兴业银行	5,228,648.00	20.58
8	600519	贵州茅台	5,160,083.00	20.31
9	600016	民生银行	5,048,580.00	19.87
10	600000	浦发银行	4,796,721.90	18.88
11	000001	平安银行	4,749,271.00	18.69
12	601169	北京银行	4,633,987.00	18.24
13	601390	中国中铁	4,615,625.66	18.17
14	000002	万 科A	4,450,923.20	17.52

15	601288	农业银行	4,397,744.00	17.31
16	002470	金正大	4,363,322.00	17.17
17	601398	工商银行	4,318,953.00	17.00
18	000333	美的集团	3,766,947.00	14.83
19	600085	同仁堂	3,608,715.00	14.20
20	600663	陆家嘴	3,547,325.52	13.96

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	12,457,150.00	49.03
2	600036	招商银行	7,303,029.84	28.74
3	601818	光大银行	7,148,199.00	28.13
4	600519	贵州茅台	6,517,358.98	25.65
5	601668	中国建筑	6,507,662.00	25.61
6	000651	格力电器	5,814,537.00	22.88
7	000001	平安银行	5,797,456.00	22.82
8	000002	万科A	5,253,247.90	20.68
9	000333	美的集团	4,388,409.00	17.27
10	601166	兴业银行	4,139,983.00	16.29
11	601398	工商银行	4,125,235.00	16.24
12	601390	中国中铁	4,007,185.00	15.77
13	600276	恒瑞医药	3,909,687.78	15.39
14	601288	农业银行	3,792,283.00	14.93
15	600016	民生银行	3,773,514.00	14.85
16	600030	中信证券	3,522,566.00	13.86
17	600085	同仁堂	3,513,922.00	13.83



18	600188	兖州煤业	3,370,301.00	13.26
19	000725	京东方 A	3,288,260.00	12.94
20	600900	长江电力	3,286,187.80	12.93

### 8.4.3 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	440,294,821.41
卖出股票收入（成交）总额	421,961,625.85

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 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	169,130.64
2	应收证券清算款	250,331.17
3	应收股利	-
4	应收利息	1,661.25
5	应收申购款	2,854.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	423,977.66

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002470	金正大	2,228,940.00	2.10	临时停牌

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600666	奥瑞德	52,896.00	0.05	临时停牌
2	300730	科创信息	34,112.55	0.03	临时停牌

注：截至本报告送出日，奥瑞德（600666）仍未复牌。

#### 8.12.6 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。

## § 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
浙商稳健	116	12,866.80	69,300.00	4.64%	1,423,249.00	95.36%
浙商进取	185	8,067.84	83,800.00	5.61%	1,408,750.00	94.39%
浙商沪深 300 指数分级	1,058	69,474.19	61,938,955.54	84.27%	11,564,740.46	15.73%
合计	1,359	56,283.15	62,092,055.54	81.18%	14,396,739.46	18.82%

### 9.2 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	郑志坤	235,337.00	15.77%
2	李元	158,297.00	10.61%
3	梁小红	152,840.00	10.24%
4	王强	102,200.00	6.85%
5	梁豹威	90,000.00	6.03%
6	黄英	89,757.00	6.01%
7	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	65,800.00	4.41%
8	马仲华	62,400.00	4.18%
9	潘苏英	61,000.00	4.09%

10	夏永清	60,000.00	4.02%
----	-----	-----------	-------

## 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	15.72%
2	刘晓亮	207,822.00	13.92%
3	周锐	150,000.00	10.05%
4	上海边域投资管理有限公司一边域海际 1 号私募证券投资基金	83,100.00	5.57%
5	王素珍	70,900.00	4.75%
6	李红	70,400.00	4.72%
7	高小涛	40,000.00	2.68%
8	吴丽丹	30,178.00	2.02%
9	魏华	26,151.00	1.75%
10	宇云	22,300.00	1.49%

## 9.3 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%

## 9.4 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

## § 10 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	92,657.00	92,657.00	180,433,508.81
减:本报告期基金总赎回份额	831,330.00	831,330.00	125,016,720.98
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	1,492,549.00	1,492,550.00	73,503,696.00

## § 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

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。

2017 年 10 月 27 日，李志惠先生离任浙商基金管理有限公司总经理职务。

2017 年 10 月 27 日，原浙商基金管理有限公司副总经理聂挺进先生就任总经理职务。

### 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	



上海证券	1	574,941,997.78	67.35%	535,445.43	65.81%	-
招商证券	1	271,887,531.62	31.85%	271,893.40	33.42%	-
国都证券	1	6,785,633.89	0.79%	6,319.48	0.78%	-

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。我公司的盖程序，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。

### 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
上海证券	6,370,364.00	100.00%	20,000,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

浙商基金管理有限公司

2018 年 3 月 30 日