
浙商日添金货币市场基金 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	浙商日添金货币市场基金	
基金简称	浙商日添金	
基金主代码	003874	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 1 日	
基金管理人	浙商基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	23,926,253,191.35 份	
下属分级基金的基金简称:	浙商日添金 A	浙商日添金 B
下属分级基金的交易代码:	003874	003875
报告期末下属分级基金的份额总额	22,416.25 份	23,926,230,775.10 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金根据对市场利率的研究与预判，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动管理投资策略，争取在满足安全性和流动性的前提下，实现较高的资产组合收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币活期存款利率（税后）。 根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取人民币活期存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浙商基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	龚小武
	联系电话	021-60350812	021-52629999-212056
	电子邮箱	guoleqi@zsfund.com	011597@cib.com.cn
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	95561
传真		0571-28191919	021-62535823

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2017 年		2016 年 12 月 1 日(基金合同生 效日)-2016 年 12 月 31 日		2015 年	
	浙商日添 金 A	浙商日添金 B	浙商日添金 A	浙商日添金 B	浙商 日添 金 A	浙商 日添 金 B
本期已实现 收益	1,177.07	1,371,978,753.03	393.62	572,091.13	-	-
本期利润	1,177.07	1,371,978,753.03	393.62	572,091.13	-	-
本期净值收 益率	3.9039%	4.1553%	0.2664%	0.2861%	-	-
3.1.2 期末 数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
期末基金资 产净值	22,416.25	23,926,230,775.10	148,149.11	200,535,496.51	-	-
期末基金份 额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	-	-
3.1.3 累计 期末指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
累计净值收 益率	4.1806%	4.4532%	0.2664%	0.2861%	-	-

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浙商日添金 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0347%	0.0011%	0.0882%	0.0000%	0.9465%	0.0011%
过去六个月	2.0149%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	1.8385%	0.0010%
过去一年	3.9039%	0.0011%	0.3500%	0.0000%	3.5539%	0.0011%
自基金合同 生效起至今	4.1806%	0.0012%	0.3797%	0.0000%	3.8009%	0.0012%

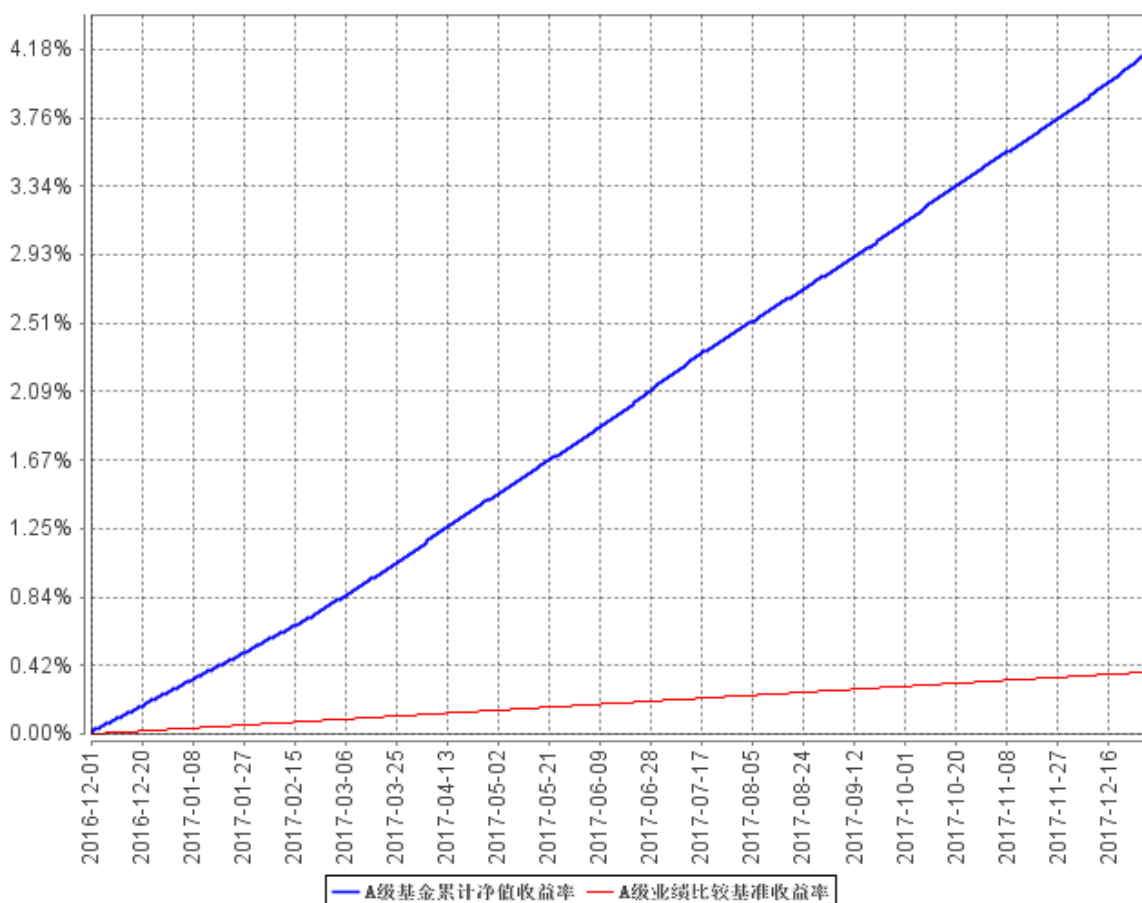
浙商日添金 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.0952%	0.0011%	0.0882%	0.0000%	1.0070%	0.0011%
过去六个月	2.1374%	0.0009%	0.1764%	0.0000%	1.9610%	0.0009%
过去一年	4.1553%	0.0011%	0.3500%	0.0000%	3.8053%	0.0011%
自基金合同 生效起至今	4.4532%	0.0012%	0.3797%	0.0000%	4.0735%	0.0012%

注：本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）收益率

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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

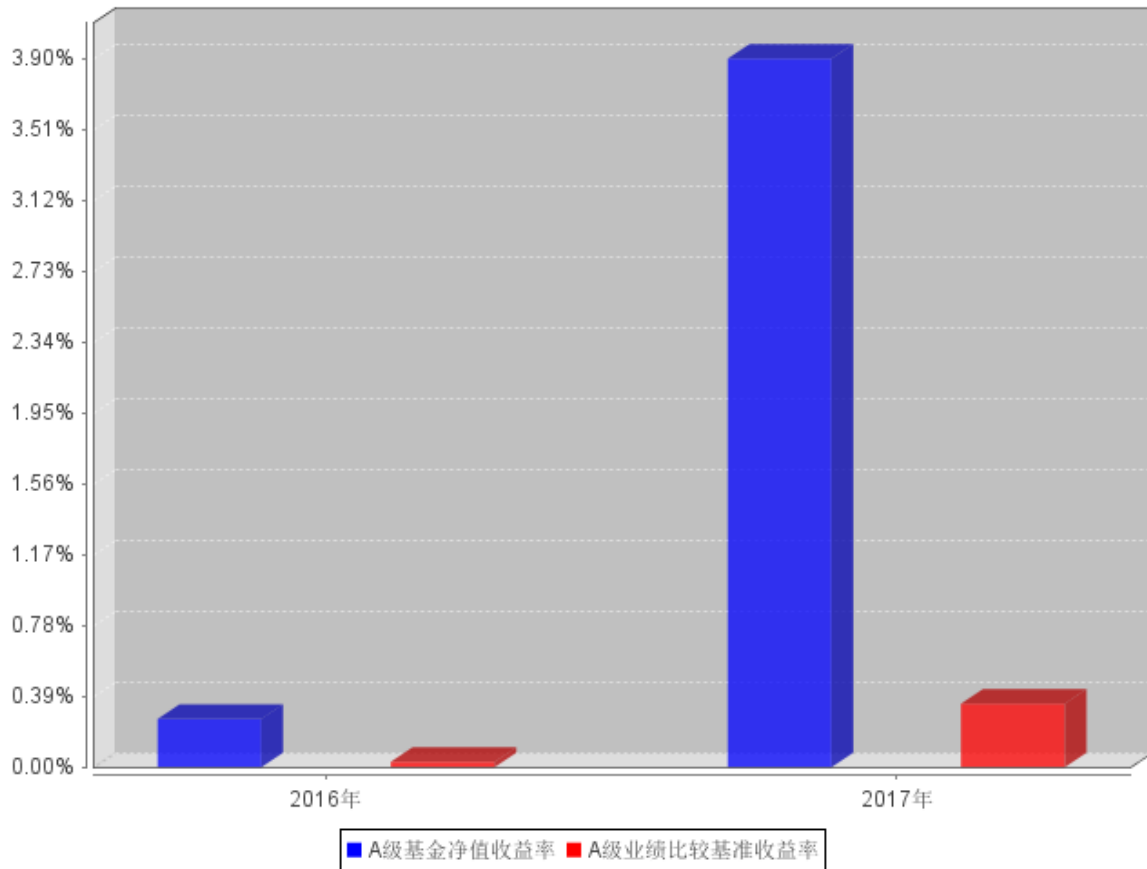


注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 12 月 1 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间已满一年。

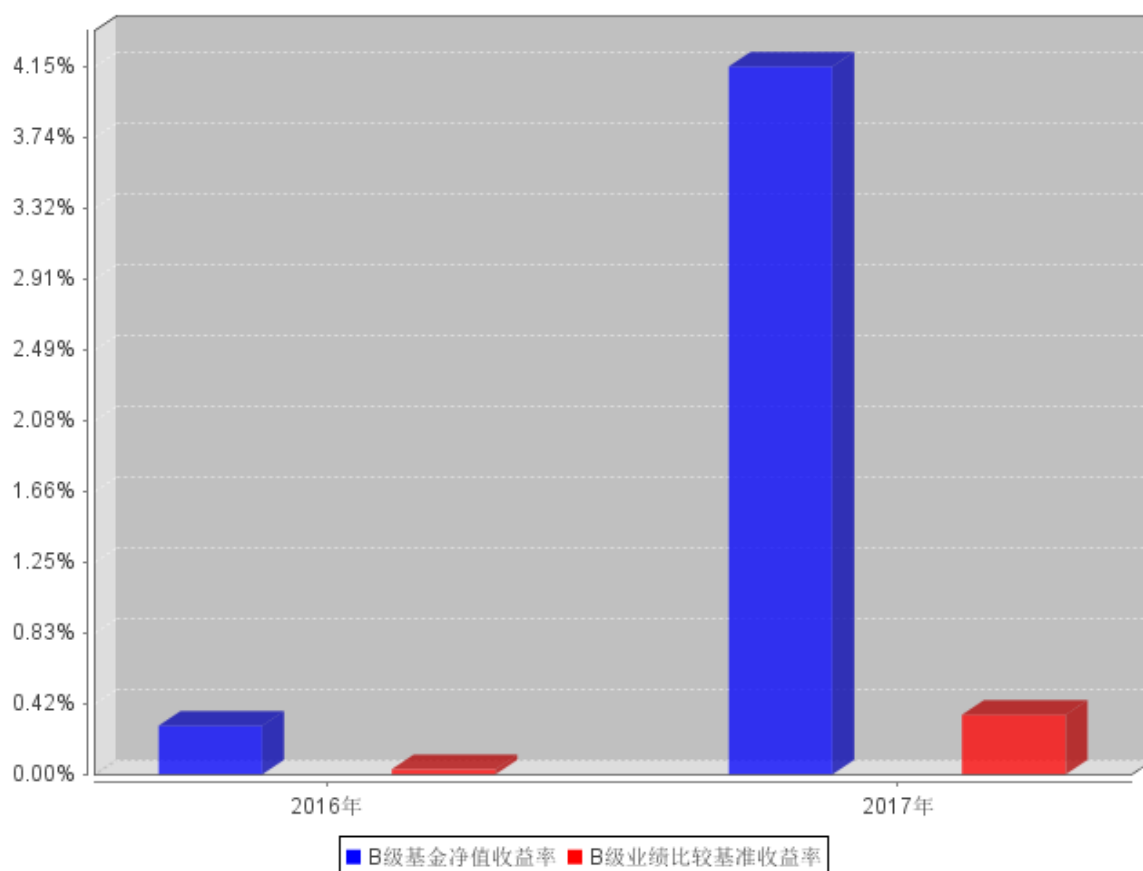
2、本基金建仓期为 6 个月，从 2016 年 12 月 1 日至 2017 年 5 月 31 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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

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



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



注：本基金 2016 年实际运作期间为 2016 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

浙商日添金 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2017	1,192.00	-	-14.93	1,177.07	-
2016	368.52	-	25.10	393.62	-
合计	1,560.52	-	10.17	1,570.69	-

单位：人民币元

浙商日添金 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2017	1,360,695,278.59	-	11,283,474.44	1,371,978,753.03	-
2016	535,496.51	-	36,594.62	572,091.13	-
合计	1,361,230,775.10	-	11,320,069.06	1,372,550,844.16	-

§ 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		
周锦程	本基金的基金经理	2017 年 2 月 17 日	-	7	周锦程先生,复旦大学经济学硕士。历任德邦证券股份有限公司债券交易员、债券研究员、债券投资经理。
吕文晔	本基金的基金经理	2016 年 12 月 1 日	2017 年 10 月 31 日	6	吕文晔先生,英国华威大学过程工程和商业管理硕士。曾任平安资产管理有限责任公司交易部债券交易员。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本基金主要投资品种为债券、同业存单及银行存款。报告期内组合久期继续保持较低水平，按公募基金流动性新规要求，调整了高流动性资产占比、剩余期限等指标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期浙商日添金 A 的基金份额净值收益率为 3.9039%，本报告期浙商日添金 B 的基金份额净值收益率为 4.1553%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年一方面宏观经济总体超预期，另一方面受金融去杠杆、货币政策收紧影响资金面水涨

船高，金融监管左右了债市的节奏。展望 2018 年，随着主要监管政策落地，债市有望回归基本面逻辑。宏观经济方面，基建投资走弱趋势明显，地产投资有一定下行压力，制造业结构改善但总量可能不足对冲基建、地产，经济增速和通胀有小幅下行空间；监管和资金方面，随着主要监管政策落地，市场进入结构调整阶段，货币政策不会进一步收紧，资金面压力总体有望缓解；海外方面，欧美延续加息周期和退出 QE，但目前人民币汇率压力不大，国内加息压力较小。对债市而言，经过 17 年的调整，目前利率债、中短期高评级信用债收益率水平相对合理、配置价值较好；但中长期、低评级信用债的信用利差保护不够，随着非标融资、地方平台融资受限，仍要防范信用债的估值风险和信用风险、对城投债的区域风险也要加强关注。总体上，随着经济目标转为追求质量，大资管行业回归资管本质，金融市场将出现较好的结构性投资机会。

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

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

本基金本报告期 A 级共分配利润 1192.00 元，其中已按红利再投资形式分配金额 1192.00 元，B 级共分配利润 1360695278.59 元，其中已按红利再投资形式分配金额 1360695278.59 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《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，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1800209 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浙商日添金货币市场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 36 页的浙商日添金货币市场基金（以下简称“浙商日添金基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度及自 2016 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</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，公允反映了浙商日添金基金 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度及自 2016 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间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，我们独立于浙商日添金基金，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>浙商日添金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。其他信息包括浙商日添金基金 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>浙商日添金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，浙商日添金基金管理人浙商基金管理有限公司管理层负责评估浙商日添金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，除非浙商日添金基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>浙商日添金基金管理人浙商基金管理有限公司治理层负责监督浙商日添金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) 评价浙商日添金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)对浙商日添金基金管理人浙商基金管理有限公司管理层使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，就可能导致对浙商日添金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日添金基金不能持续经营。</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> <p>我们与浙商日添金基金管理人浙商基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</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	王国蓓 叶凯韵
会计师事务所的地址	上海南京西路 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：浙商日添金货币市场基金

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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	13,963,252,923.21	190,203,760.06
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,528,310,835.18	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,528,310,835.18	-
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	7,343,704,222.68	10,000,000.00
应收证券清算款		-	8,827.78
应收利息	7.4.7.5	107,242,434.60	567,575.10
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		23,942,510,415.67	200,780,162.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,359,229.65	24,640.59
应付托管费		1,119,743.19	8,213.51
应付销售服务费		223,953.09	1,671.83
应付交易费用	7.4.7.7	87,869.12	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		11,320,079.23	36,619.72
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	146,350.04	25,371.67
负债合计		16,257,224.32	96,517.32
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	23,926,253,191.35	200,683,645.62
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		23,926,253,191.35	200,683,645.62
负债和所有者权益总计		23,942,510,415.67	200,780,162.94

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 23,926,253,191.35 份。本基金 A 类份额净值为 1.0000 元，份额总额 22,416.25 份；B 类份额净值 1.0000 元，份额总额 23,926,230,775.10 份。

7.2 利润表

会计主体：浙商日添金货币市场基金

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 12 月 1 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		1,442,589,763.97	632,782.35
1.利息收入		1,442,633,129.23	632,782.35
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,154,359,626.30	613,682.29
债券利息收入		131,765,951.96	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		156,507,550.97	19,100.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-43,365.26	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-43,365.26	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-	-
减:二、费用		70,609,833.87	60,297.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	49,236,725.48	24,640.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	16,412,241.91	8,213.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,282,526.09	1,671.83
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		1,358,459.14	-
其中: 卖出回购金融资产支出		1,358,459.14	-
6. 其他费用	7.4.7.20	319,881.25	25,771.67
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,371,979,930.10	572,484.75
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,371,979,930.10	572,484.75

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 浙商日添金货币市场基金

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)	200,683,645.62	-	200,683,645.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,371,979,930.10	1,371,979,930.10
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)	23,725,569,545.73	-	23,725,569,545.73
其中: 1. 基金申购款	46,360,703,652.44	-	46,360,703,652.44
2. 基金赎回款	-22,635,134,106.71	-	-22,635,134,106.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-1,371,979,930.10	-1,371,979,930.10
五、期末所有者权益(基金净值)	23,926,253,191.35	-	23,926,253,191.35

项目	上年度可比期间 2016 年 12 月 1 日(基金合同生效日)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)	200,147,780.59	-	200,147,780.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	572,484.75	572,484.75
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)	535,865.03	-	535,865.03
其中：1. 基金申购款	535,865.03	-	535,865.03
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-572,484.75	-572,484.75
五、期末所有者权益(基金净值)	200,683,645.62	-	200,683,645.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

_____ 聂挺进	_____ 唐生林	_____ 唐生林
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浙商日添金货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予浙商日添金货币市场基金注册的批复》（证监许可 [2016]2650 号）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《浙商日添金货币市场基金基金合同》发售，基金合同于 2016 年 12 月 1 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为浙商基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。本基金于 2016 年 11 月 28 日募集，募集期间净认购资金人民币 200,147,780.59，认购资金在募集期间孳生利息人民币零元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 200,147,780.59 份。其中 A 类有效认购资金人民币 147,780.59 元，

折合 147,780.59 份本基金 A 类份额；B 类有效认购资金人民币 200,000,000.00 元，折合 200,000,000.00 份本基金 B 类份额。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第 1600893 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《浙商日添金货币市场基金基金合同》和《浙商日添金货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 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 日及 2016 年 12 月 31 日的财务状况、2017 年度及自 2016 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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。本期财务报表的实际编制期间为自 2016 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

存在活跃市场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。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和

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

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

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

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

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

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

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

个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益。

7.4.4.11 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。

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

本基金在本年度及自2016年12月1日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度及自2016年12月1日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度及自2016年12月1日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间均未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政

策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《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) 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、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行	基金托管人
浙商证券股份有限公司	基金管理人的股东
通联资本管理有限公司	基金管理人的股东
浙江浙大网新集团有限公司	基金管理人的股东
养生堂有限公司	基金管理人的股东
上海聚潮资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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

本基金在本年度与自 2016 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 12 月 1 日(基金合同生效 日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	49,236,725.48	24,640.59
其中：支付销售机构的客户维护费	23.37	9.60

注：支付基金管理人浙商基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 12 月 1 日(基金合同生效 日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,412,241.91	8,213.51

注：支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	浙商日添金 A	浙商日添金 B	合计
浙商直销	0.00	3,282,445.11	3,282,445.11
合计	0.00	3,282,445.11	3,282,445.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 12 月 1 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浙商日添金 A	浙商日添金 B	合计
浙商直销	0.00	1,641.44	1,641.44
合计	0.00	1,641.44	1,641.44

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

浙商日添金 A 日基金销售服务费=前一日 A 类份额基金资产净值×0.25%/当年天数

浙商日添金 B 日基金销售服务费=前一日 B 类份额基金资产净值×0.01%/当年天数

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本年度与自 2016 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本年度与自 2016 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间均未持有过本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上期末未持有本基金。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 12 月 1 日(基金合同生效日)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
兴业银行股份有限公司	512,252,923.21	154,184,052.29	10,203,760.06	42,099.03

注：本基金通过“兴业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 日的相关余额为零(2016 年 12 月 31 日：零)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与自 2016 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间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

金额单位：人民币元

浙商日添金A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
1,192.00	-	-14.93	1,177.07	-

浙商日添金B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
1,360,695,278.59	-	11,283,474.44	1,371,978,753.03	-

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

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

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

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	固定收益投资	2,528,310,835.18	10.56
	其中:债券	2,528,310,835.18	10.56
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,343,704,222.68	30.67
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	1,737,415,053.25	7.26
3	银行存款和结算备付金合计	13,963,252,923.21	58.32
4	其他各项资产	107,242,434.60	0.45
5	合计	23,942,510,415.67	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.11	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	22

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限违规超过 120 天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	75.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	12.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	11.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.62	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期限违规超过 240 天的情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	867,499,553.99	3.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	600,023,083.31	2.51
	其中：政策性金融债	600,023,083.31	2.51
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,060,788,197.88	4.43
8	其他	-	-
9	合计	2,528,310,835.18	10.57
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	179951	17 贴现国债 51	6,600,000	657,759,303.00	2.75
2	111770080	17 上海农商银行 CD214	4,000,000	396,774,379.94	1.66
3	111709480	17 浦发银行 CD480	3,700,000	366,859,449.35	1.53
4	111708425	17 中信银行 CD425	3,000,000	297,154,368.59	1.24
5	150401	15 农发 01	2,500,000	250,008,748.80	1.04
6	179947	17 贴现国债 47	2,100,000	209,740,250.99	0.88
7	170401	17 农发 01	1,500,000	149,995,265.54	0.63
8	150201	15 国开 01	800,000	80,008,079.58	0.33
9	120326	12 进出 26	500,000	50,007,166.53	0.21
10	130401	13 农发 01	300,000	30,014,195.55	0.13

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0044%
报告期内偏离度的最低值	-0.0071%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0015%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

8.9.2

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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	107,242,434.60
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	107,242,434.60

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
浙商日添金 A	313	71.62	103.25	0.46%	22,313.00	99.54%
浙商日添金 B	1	23,926,230,775.10	23,926,230,775.10	100.00%	0.00	0.00%
合计	314	76,198,258.57	23,926,230,878.35	100.00%	22,313.00	0.00%

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

本基金不属于上市基金。

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	浙商日添金 A	1,097.59	4.9000%
	浙商日添金 B	0.00	0.0000%
	合计	1,097.59	0.0000%

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	浙商日添金 A	0~10
	浙商日添金 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	浙商日添金 A	0~10

	浙商日添金 B	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	浙商日添金 A	浙商日添金 B
基金合同生效日（2016 年 12 月 1 日）基金份额总额	147,780.59	200,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	148,149.11	200,535,496.51
本报告期基金总申购份额	8,373.85	46,360,695,278.59
减:本报告期基金总赎回份额	134,106.71	22,635,000,000.00
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	22,416.25	23,926,230,775.10

§ 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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

华福证券	2	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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) 退租或者新增券商交易单元：新增华福证券交易单元 22656、001616。

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
华福证券	-	-	57,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

浙商基金管理有限公司

2018 年 3 月 30 日