

# 浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金2017年半年度 报告摘要

2017年06月30日

基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2017年08月29日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会、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。本半年度报告已经过全部董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

浙江浙商证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、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6月30日止。

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	浙商中证转型成长指数
基金主代码	003366
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月19日
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	145,524,500.28

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.50%，年跟踪误差不超过6%，实现对中证转型成长指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证转型成长指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	95%×中证转型成长指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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	浙江浙商证券资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 姓名	高玮	张建春

露负责 人	联系电话	0571-87901963	010-63639180
	电子邮箱	gaowei@stocke.com.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		95345	95595
传真		0571-87902581	010-63639132

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.stocke.com.cn
基金半年度报告备置地点	杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼

## § 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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年01月01日-2017年06月30日）
本期已实现收益	-5,043,889.06
本期利润	-2,486,968.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0149
本期加权平均净值利润率	-1.49%
本期基金份额净值增长率	-2.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年06月30日）
期末可供分配利润	-5,827,227.83
期末可供分配基金份额利润	-0.0400
期末基金资产净值	142,341,268.23
期末基金份额净值	0.9780
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017年06月30日）
基金份额累计净值增长率	-2.20%

注：1、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入（不包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。

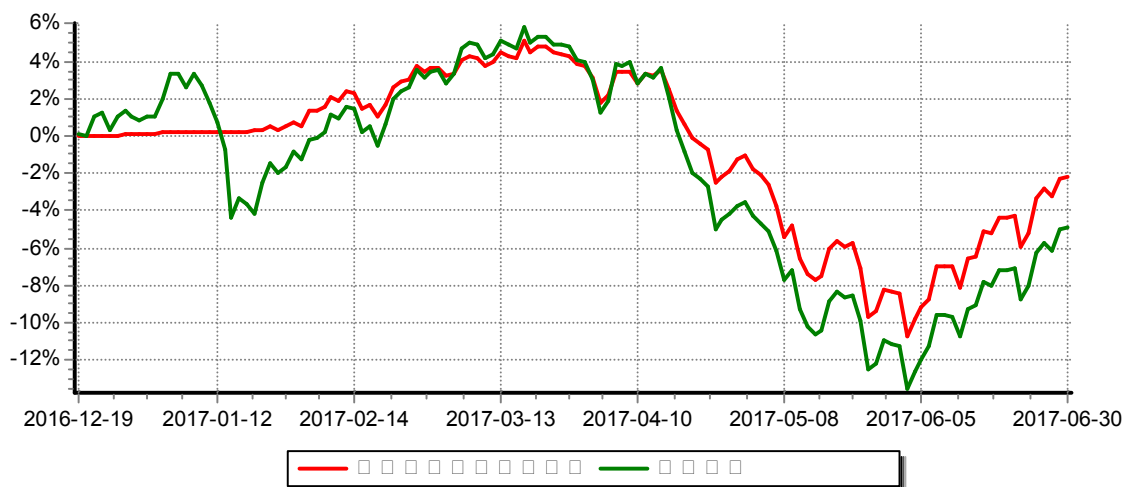
3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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	6.77%	1.09%	7.10%	1.14%	-0.33%	-0.05%
过去三个月	-4.31%	1.02%	-6.73%	1.14%	2.42%	-0.12%
过去六个月	-2.30%	0.78%	-5.94%	1.03%	3.64%	-0.25%
自基金合同生效日起至今（2016年12月19日-2017年06月30日）	-2.20%	0.74%	-4.94%	0.99%	2.74%	-0.25%

#### 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



注：本基金于2016年12月19日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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

浙江浙商证券资产管理有限公司成立于2013年4月18日，是原浙商证券有限责任公司设立的全资子公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准浙商证券有限责任公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可（2012）1431号）批准，由浙商证券有限责任公司出资5亿元从事资产管理业务。2014年8月19日中国证券监督管理委员会批准《关于核准浙江浙商证券资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可（2014）857号）。公司主要经营范围涉及证券资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务。截止2017年6月30日，本基金管理人管理浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金和浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫幼林	本基金基金经理；	2016年12月19日	—	7年	计算机科学与技术专业学士和硕士学位。历任穆迪Analytics工程师, 华安基金管理有限公司高级风险分析师。2014年加入浙江浙商证券资产管理有限公司, 担任量化投资部研究员。2016年起任浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金经理。

注：上述表格内基金经理的任职日期、离职日期均指公司作出决定并公告披露之日。证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，浙江浙商证券资产管理有限公司作为浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金的管理人，严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，谋求基金资产的长期稳定增长，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基

金合同的规定。

### 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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《浙江浙商证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

### 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

在本报告期内，A股市场风格分化明显，优质大盘股屡创新高，而中小盘股票整体估值水平较高，表现不佳；本基金作为指数基金，在保证对业绩基准紧密跟踪的前提下，严格按照基金合同要求，在指数成份股变动时，尽量降低交易成本、减少市场冲击带来的影响，并在基金成立后前半年的建仓期中采取了灵活的建仓策略，实现了部分超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2017年06月30日，本基金份额净值为0.978元，累计净值为0.978元。报告期内，本基金的净值增长率为-2.30%，业绩比较基准收益率为-5.94%。

### 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年上半年，中小盘股票经历了大幅调整，估值风险得到较为充分的释放，短期风险偏好有所修复。

展望2017年下半年，经济景气对市场仍有较强支撑，业绩优良、成长性好的股票将继续受到市场青睐；货币政策和财政政策将继续保持稳健，监管政策更加注重金融市场风险的防范，新股发行速度不减，未来将成为常态。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定及我司估值政策和程序，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。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

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

本报告期内，本基金未发生《公开募集证券投资基金运行管理办法》的第四十一条所述情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——浙江浙商证券资产管理有限公司的投资运



作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——浙江浙商证券资产管理有限公司编制的《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金2017年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 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：浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款		10,517,773.09	17,868,706.97
结算备付金		1,033,773.33	—
存出保证金		198,207.21	—
交易性金融资产		131,767,931.57	1,808,083.00
其中：股票投资		131,767,931.57	1,808,083.00
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		—	—
买入返售金融资产		—	205,500,000.00
应收证券清算款		76,677.18	—
应收利息		2,722.60	314,851.38
应收股利		—	—

浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金2017年半年度报告摘要

应收申购款		642.30	—
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		143,597,727.28	225,491,641.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		76,209.71	—
应付赎回款		429,756.29	—
应付管理人报酬		135,833.85	88,611.31
应付托管费		16,979.24	11,076.41
应付销售服务费		—	—
应付交易费用		465,367.78	1,401.41
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		132,312.18	5,603.85
负债合计		1,256,459.05	106,692.98
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		145,524,500.28	225,139,846.09
未分配利润		-3,183,232.05	245,102.28
所有者权益合计		142,341,268.23	225,384,948.37
负债和所有者权益总计		143,597,727.28	225,491,641.35

注：（1）本基金于2016年12月19日成立。

（2）报告截止日2017年6月30日，基金份额净值0.978元，基金份额总额145,524,500.28份。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2017年01月01日-2017年06月30日
<b>一、收入</b>		6,773.28
1. 利息收入		716,239.14
其中：存款利息收入		197,872.50
债券利息收入		—
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		518,366.64
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,545,575.36
其中：股票投资收益		-4,083,990.67
基金投资收益		—
债券投资收益		—
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益		—
股利收益		538,415.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		2,556,921.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		279,188.50
<b>减：二、费用</b>		2,493,741.34
1. 管理人报酬		992,723.35

2. 托管费		124,090.42
3. 销售服务费		—
4. 交易费用		1,194,672.12
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用		182,255.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,486,968.06
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,486,968.06

注：本基金于2016年12月19日成立，无上半年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日-2017年06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)	225,139,846.09	245,102.28	225,384,948.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-2,486,968.06	-2,486,968.06
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）	-79,615,345.81	-941,366.27	-80,556,712.08
其中：1. 基金申购款	4,931,410.50	70,147.30	5,001,557.80
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-84,546,756.31	-1,011,513.57	-85,558,269.88
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）	145,524,500.28	-3,183,232.05	142,341,268.23

注：本基金于2016年12月19日成立，无上半年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

李雪峰

盛建龙

冯建兰

-----

-----

-----

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

主管会计工作负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金(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”)(证监许可[2015]2247号)《关于准予浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金注册的批复》批准,由浙江浙商证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金合同》向社会公开发行人募集。《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金合同》于2016年12月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为225,139,846.09份基金份额,相关募集业经北京兴华会计师事务所[2016]京会兴浙分验字第68000106号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。基金管理人为浙江浙商证券资产管理有限公司,注册登记机构为浙江浙商证券资产管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)并参照《证券投资基金会计核算业务指引》及《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金合同》的规定而编制的。

本财务报表以持续经营为基础列报。

### 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于2017年6月

30日的财务状况以及2017年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金合同生效日为2016年12月19日，无上年度同期对比数据。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制，即自每年1月1日至12月31日为一个会计年度。本报告会计期间为2017年1月1日至2017年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：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。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票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。除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外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。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。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

##### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）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；或者（3）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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、衍生工具等金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

（2）存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

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

#### 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。当本基金1)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；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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。由于申购和赎回引起的实收基金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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期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

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；
- (3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在证券回购期内逐日计提；
- (4) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
- (5) 债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；
- (6) 基金投资收益/(损失)于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额与其成本的差额入账；
- (7) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除个人所得税后的净额入账；
- (8) 公允价值变动收益/(损失)系本集合计划持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、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；
- (9) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 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。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期费用。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，此误差产生的收益或损失由基金资产承担；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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[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》，根据具体情况采用《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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### 6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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。
- (2) 基金买卖股票的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税。持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息、红利收入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，暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 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。

#### 6.4.7 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浙江浙商证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商证券股份有限公司	基金管理人的母公司、本基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构

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。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
浙商证券股份 有限公司	336,576,214.67	37.25%

注：本基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

本基金于本报告期末，未发生债券交易。本基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2017年01月01日-2017年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购总量的比例
浙商证券股份有限公司	152,000,000.00	100.00%

注：本基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金于本报告期末，未发生权证交易。本基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
浙商证券股份有限公司	313,452.67	43.05%	49,759.60	10.69%

注：本基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	992,723.35

其中：支付销售机构的客户维护费	—
-----------------	---

注：(1)本基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

(2)本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	124,090.42

注：(1)本基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

(2)本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易的情况，并且基金合同生效日为2016年12月19日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日

期初持有的基金份额	10,001,430.56
期间申购/买入总份额	—
期间因拆分变动份额	—
减：期间赎回/卖出总份额	—
期末持有的基金份额	10,001,430.56
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	6.87%

注：本基金的基金管理人在本报告期间内未运用固有资金投资本基金，基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

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

本报告期末未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况，本基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	期末 余额	当期 存款利息收入
中国光大银行 活期存款	10,517,773.09	181,976.64

注：本基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券的情况。本基金合同生效日为2016年12月19日，可比期间不完整，无同期对比数据。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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	期末成本总额	期末估值总额
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股申购	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股申购	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股申购	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股申购	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股申购	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36

#### 6.4.9.2 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	期末成本总额	期末估值总额
600657	信达地产	2017-02-20	重大资产重组	5.76		—	240,200	1,385,967.30	1,383,552.00
000838	财信发展	2017-05-02	重大资产重组	6.59		—	189,700	1,515,757.21	1,250,123.00
600734	实达集团	2017-04-05	重大资产重组	12.75	2017-07-12	12.00	76,800	1,101,248.43	979,200.00

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	131,767,931.57	91.76
	其中：股票	131,767,931.57	91.76
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	11,551,546.42	8.04
7	其他各项资产	278,249.29	0.19
8	合计	143,597,727.28	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

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	—	—
B	采矿业	12,144,909.00	8.53
C	制造业	78,330,128.30	55.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,753,279.16	4.04
E	建筑业	4,554,728.00	3.20
F	批发和零售业	3,310,252.00	2.33

G	交通运输、仓储和邮政业	4,205,562.00	2.95
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,957,776.00	2.08
J	金融业	—	—
K	房地产业	12,986,237.00	9.12
L	租赁和商务服务业	1,368,064.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	3,147,643.20	2.21
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,299,576.00	0.91
S	综合	1,554,960.00	1.09
	合计	131,613,114.66	92.46

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	147,177.29	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.01
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—



M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	154,816.91	0.11

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000510	金路集团	197,000	1,790,730.00	1.26
2	002136	安纳达	99,400	1,741,488.00	1.22
3	000951	中国重汽	110,900	1,695,661.00	1.19
4	300355	蒙草生态	157,280	1,689,187.20	1.19
5	000626	远大控股	90,700	1,687,020.00	1.19
6	600740	山西焦化	239,620	1,686,924.80	1.19
7	002636	金安国纪	96,300	1,663,101.00	1.17
8	000878	云南铜业	124,200	1,638,198.00	1.15
9	002061	江山化工	172,700	1,637,196.00	1.15
10	600230	沧州大化	54,800	1,628,656.00	1.14

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网址

[www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)上的半年度报告全文。

#### 7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03

2	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
3	002881	美格智能	989	22,608.54	0.02
4	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
5	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网址 [www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn) 上的半年度报告全文。

## 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	600711	盛屯矿业	4,780,716.50	2.12
2	600325	华发股份	3,965,351.00	1.76
3	002048	宁波华翔	3,861,377.44	1.71
4	600751	天海投资	3,774,546.62	1.67
5	603609	禾丰牧业	3,448,504.38	1.53
6	002722	金轮股份	3,322,855.46	1.47
7	000688	建新矿业	3,311,062.68	1.47
8	002458	益生股份	3,272,420.10	1.45
9	002354	天神娱乐	3,239,214.16	1.44
10	600230	沧州大化	3,226,070.00	1.43
11	600057	象屿股份	3,203,557.45	1.42
12	600986	科达股份	3,150,886.00	1.40
13	000915	山大华特	3,111,883.70	1.38
14	002172	澳洋科技	3,070,899.09	1.36
15	600077	宋都股份	3,060,644.38	1.36
16	300048	合康新能	3,056,757.46	1.36
17	000957	中通客车	3,043,637.54	1.35
18	300287	飞利信	3,042,551.30	1.35
19	600988	赤峰黄金	3,042,382.00	1.35

20	002234	民和股份	3,016,973.13	1.34
----	--------	------	--------------	------

注：表中“买入金额”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。

#### 7.4.2 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	600325	华发股份	4,035,817.00	1.79
2	600711	盛屯矿业	3,444,684.00	1.53
3	000915	山大华特	3,297,375.85	1.46
4	002458	益生股份	3,258,096.55	1.45
5	600185	格力地产	3,072,395.95	1.36
6	600057	象屿股份	3,068,030.16	1.36
7	300048	合康新能	3,045,493.39	1.35
8	002722	金轮股份	2,996,521.75	1.33
9	000957	中通客车	2,963,037.64	1.31
10	300287	飞利信	2,932,508.90	1.30
11	000688	建新矿业	2,927,383.06	1.30
12	600077	宋都股份	2,914,559.75	1.29
13	000070	特发信息	2,870,445.79	1.27
14	002234	民和股份	2,849,576.11	1.26
15	600000	浦发银行	2,827,394.99	1.25
16	600988	赤峰黄金	2,826,405.00	1.25
17	600015	华夏银行	2,796,604.00	1.24
18	600531	豫光金铅	2,777,225.51	1.23
19	002298	中电鑫龙	2,772,713.27	1.23
20	600075	新疆天业	2,741,250.82	1.22

注：表中“卖出金额”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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	517,957,880.70
---------------	----------------

卖出股票的收入（成交）总额	386,470,962.46
---------------	----------------

注：表中“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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进行贵金属投资。

## 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

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

### 7.10.1 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的四川金路集团股份有限公司（金路集团，代码：000510）于2017年6月2日发布《关于公司大股东、实际控制人收到证监会调查通知书的公告》称，收到公司大股东、实际控制人刘江东先生通知，因涉嫌信息披露不实等违法违规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证券监督管理委员会决

定对其立案调查。目前，公司生产经营情况正常，公司将督促刘江东先生积极配合监管机构相关调查工作，并严格按照监管要求履行信息披露义务。

本基金投资该公司的逻辑是公司主导产品PVC树脂及烧碱销售价格同比上升，使得公司较2016年同期相比利润增加。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 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	198,207.21
2	应收证券清算款	76,677.18
3	应收股利	—
4	应收利息	2,722.60
5	应收申购款	642.30
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	278,249.29

### 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可转债。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 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	002879	长缆科技	23,660.26	0.02	新股认购
2	002882	金龙羽	18,389.20	0.01	新股认购

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

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
2,082	69,896.50	10,001,430.56	6.87%	135,523,069.72	93.12%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	409,700.60	0.28%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年12月19日)基金份额总额	225,139,846.09
本报告期基金总申购份额	4,931,410.50
减：本报告期基金总赎回份额	84,546,756.31
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	145,524,500.28

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

## 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

基金管理人无重大人事变动。

基金托管人无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同成立以来一直聘请北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、托管人的业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

## 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	1	566,931,684.42	62.75%	—	—	—	—	—	—	414,596.51	56.95%	
浙商证券	2	336,576,214.67	37.25%	—	—	152,000,000.00	100.00%	—	—	313,452.67	43.05%	

注：a) 本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格，上海证券市场只能使用母公司浙商证券席位进行交易。截至报告期末，本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。本报告期内，交易单元无变更。

b) 本公司作为浙商证券股份有限公司的全资子公司，根据交易所一般要求，优先租用浙商证券的交

易单元。本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况及其他影响投资者决策的其他重要信息。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二〇一七年八月二十九日