

浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金2017年半年度报告

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。

§1	重要提示及目录	2
§2	基金简介	5
	2.1 基金基本情况	5
	2.2 基金产品说明	5
	2.3 基金管理人和基金托管人	6
	2.4 信息披露方式	6
	2.5 其他相关资料	6
§3	主要财务指标和基金净值表现	7
	3.1 主要会计数据和财务指标	7
	3.2 基金净值表现	7
§4	管理人报告	7
	4.1 基金管理人及基金经理情况	9
	4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
	4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
	4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
	4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
	4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
	4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5	托管人报告	12
	5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
	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	12
	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	13
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
	6.1 资产负债表	13
	6.2 利润表	15
	6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
	6.4 报表附注	17
§7	投资组合报告	35
	7.1 期末基金资产组合情况	35
	7.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
	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	37
	7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
	7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
	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	38
	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	38
	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	38
	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	38
	7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
	7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
	7.12 投资组合报告附注	39
§8	基金份额持有人信息	40
	8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
	8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	40
§9	开放式基金份额变动	41
§10	重大事件揭示	41
	10.1 基金份额持有人大会决议	41
	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	41
	10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
	10.4 基金投资策略的改变	42
	10.5 基金改聘会计师事务所情况	42
	10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	42

10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8	其他重大事件.....	43
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	45
§12	备查文件目录.....	45
12.1	备查文件目录.....	45
12.2	存放地点.....	45
12.3	查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	浙商汇金聚利一年定期	
基金主代码	002805	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2016年08月01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	211,389,183.07	
下属两级基金的基金简称	浙商汇金聚利一年定期A	浙商汇金聚利一年定期C
下属两级基金的交易代码	002805	002806
报告期末下属两级基金的份 额总额	99,764,847.60	111,624,335.47

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>资产配置策略</p> <p>本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，自上而下决定资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>债券投资组合策略</p> <p>在债券组合的构建和调整上，本基金综合运用久期配置、期限结构配置、类属资产配置、收益率曲线策略、杠杆放大策略等组合管理手段进行日常管理。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比</p>

	例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合全价指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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
信息披露负责人	姓名	高玮	张建春
	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
注册地址		杭州市下城区天水巷25号	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		310020	100033
法定代表人		李雪峰	唐双宁

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》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	浙江浙商证券资产管理有限公司	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

	浙商汇金聚利一年定期A	浙商汇金聚利一年定期C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）	
本期已实现收益	836,918.32	716,483.38
本期利润	1,105,018.40	1,013,896.91
加权平均基金份额本期利润	0.0111	0.0091
本期基金加权平均净值利润率	1.12%	0.92%
本期基金份额净值增长率	1.11%	0.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	-175,004.08	-601,203.50
期末可供分配基金份额利润	-0.0018	-0.0054
期末基金资产净值	99,589,843.52	111,023,131.97
期末基金份额净值	0.9980	0.9950
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.20%	-0.50%

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。

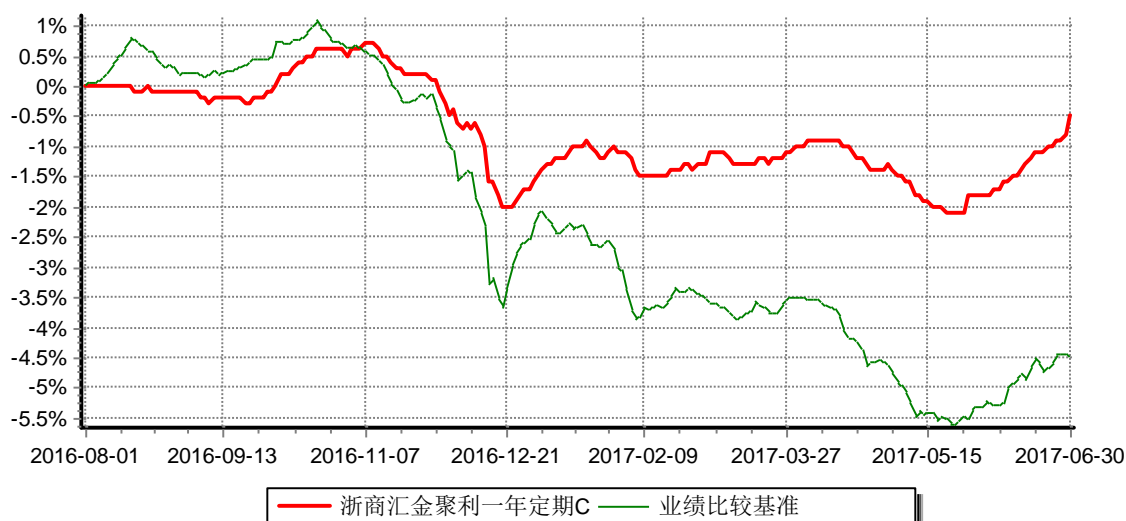
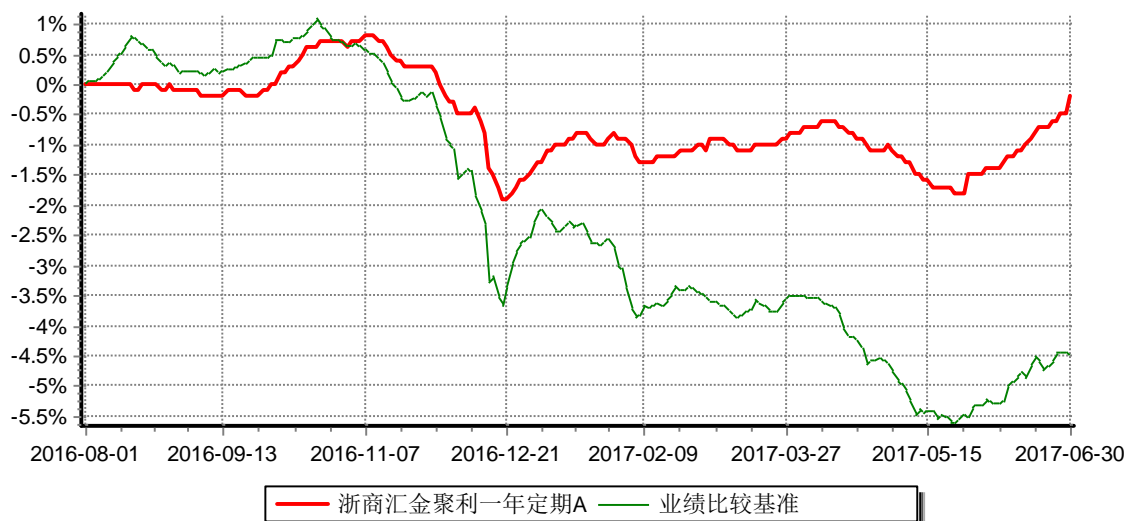
3.2 基金净值表现

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	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④

(浙商汇金聚利一年定期A)	率①	率标准差②	收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	1.32%	0.07%	0.90%	0.06%	0.42%	0.01%
过去三个月	0.50%	0.09%	-0.88%	0.08%	1.38%	0.01%
过去六个月	1.11%	0.08%	-2.11%	0.08%	3.22%	0.00%
自基金合同生效日起至今(2016年08月01日-2017年06月30日)	-0.20%	0.09%	-4.07%	0.10%	3.87%	-0.01%
阶段 (浙商汇金聚利一年定期C)	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	1.32%	0.07%	0.90%	0.06%	0.42%	0.01%
过去三个月	0.51%	0.09%	-0.88%	0.08%	1.39%	0.01%
过去六个月	0.91%	0.08%	-2.11%	0.08%	3.02%	0.00%
自基金合同生效日起至今(2016年08月01日-2017年06月30日)	-0.50%	0.09%	-4.07%	0.10%	3.57%	-0.01%

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8月1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		
欧阳丹	本基金基金经理	2016年08月01日	—	9年	硕士，历任中诚信国际信用评级有限公司分析师，长城人寿保险股份有限公司信用研究员、固定收益投资经理。2014年加入本公司，现任浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注：（1）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。

（2）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合规守信情况的说明

本报告期，浙江浙商证券资产管理有限公司作为浙商汇金聚利一年定期开放债券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》、《浙商汇金聚利一年定期开放债券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，以尽可能减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，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

基本面来看，上半年固定资产投资增速呈现下行趋势，其中基建和地产两大板块增速均不同程度出现降低。从消费来看，整体保持平稳。出口方面，受海外经济体需求复苏的带动，出口同比有所改善。物价方面，上半年CPI出现缓慢回升，PPI则加速回落。货币金融数据方面，上半年M2增速历史上首次跌破10%。整体来看，宏观经济保持出一定的韧性，但持续性仍有待观察。

债券市场方面，上半年债券市场整体呈现震荡走势。一季度受到央行上调公开市场利率、监管政策持续加码以及经济数据向好等多重利空因素的影响，收益率快速上行并创下年内高点；进入5月中旬后，监管态度有所缓和，同时央行通过超量投放MLF来引导情绪修复，收益率从高位小幅回落转入窄幅区间震荡。6月中旬开始，货币当局再次发声来稳定市场流动性预期，同时美联储加息落地，债市情绪提振收益率开始震荡下行。

本基金在上半年把握了市场回暖的时间窗口，积极降低仓位和组合久期，同时考虑到产品将在8月份进行开放，提前调整持仓结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2017年6月30日，本基金A类份额净值为0.9980元，报告期内，本基金A类份额净值增长率为1.11%，同期业绩基准增长率-2.11%；本基金C类份额净值为0.9950元，报告期内，本基金C类份额净值增长率为0.91%，同期业绩基准增长率-2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，今年以来市场的主要矛盾在于监管政策的演变，基本面并未对市场构成实质性利空。考虑到在上半年强监管政策对后续基本面的影响将不断显现，我们认为市场收益率的最高点已经过去，但考虑到宏观经济的韧性以及当前去杠杆的大背景，未来市场将呈现震荡向下的趋势。

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聚利一年定期开放债券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，对浙商汇金聚利一年定期开放债券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《浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金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：浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,190,871.33	1,472,329.11
结算备付金		15,649,228.66	386,110.21
存出保证金		70.79	11,747.46
交易性金融资产	6.4.7.2	141,018,549.59	244,427,354.99
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		106,795,817.40	210,204,622.80
资产支持证券投资		34,222,732.19	34,222,732.19
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	49,700,554.55	—

应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	3,707,084.14	5,701,051.98
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		211,266,359.06	251,998,593.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30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		—	—
卖出回购金融资产款		—	42,959,755.06
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		120,113.11	123,938.31
应付托管费		34,318.01	35,410.95
应付销售服务费		403,534.85	185,098.19
应付交易费用	6.4.7.6	11,115.04	14,109.64
应交税费		—	—
应付利息		—	16,221.42
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.7	84,302.56	170,000.00
负债合计		653,383.57	43,504,533.57
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	211,389,183.07	211,389,183.07
未分配利润	6.4.7.9	-776,207.58	-2,895,122.89
所有者权益合计		210,612,975.49	208,494,060.18

负债和所有者权益总计		211,266,359.06	251,998,593.75
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值0.996元，基金份额总额211,389,183.07份；汇金聚利一年定期A类基金份额净值为0.998元，基金份额总额99,764,847.60份；汇金聚利一年定期C类基金份额净值为0.995元，基金份额总额111,624,335.47份。

6.2 利润表

会计主体：浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金

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
一、收入		3,859,738.15
1.利息收入		6,621,187.76
其中：存款利息收入	6.4.7 .10	16,819.39
债券利息收入		5,383,123.87
资产支持证券利息收入		1,082,598.63
买入返售金融资产收入		138,645.87
其他利息收入		—
2.投资收益		-3,326,963.22
其中：股票投资收益	6.4.7 .11	—
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7 .12	-3,326,963.22
资产支持证券投资收益	6.4.7 .12.3	—
贵金属投资收益	6.4.7 .13	—
衍生工具收益	6.4.7 .14	—

股利收益	6.47 .15	—
3.公允价值变动收益	6.47 .16	565,513.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.47 .17	—
减：二、费用		1,740,822.84
1. 管理人报酬		724,981.58
2. 托管费		207,137.58
3. 销售服务费		218,485.26
4. 交易费用	6.47 .18	9,475.43
5. 利息支出		477,838.63
其中：卖出回购金融资产支出		477,838.63
6. 其他费用	6.47 .19	102,904.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,118,915.31
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,118,915.31

注：本基金合同生效日为2016年8月1日，无上年度同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金

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	211,389,183.07	-2,895,122.89	208,494,060.18

值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	2,118,915.31	2,118,915.31
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)	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—
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)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	211,389,183.07	-776,207.58	210,612,975.49

注：本基金合同生效日为2016年8月1日，无上年度同期对比数据。

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

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会证监许可[2016]980号《关于准予浙商汇金聚利一年定期开放债券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《浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》向社会公开发行募集。

《浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2016年8月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为211,389,183.07份，其中A类基金份额为99,764,847.60份，C类基金份额为111,624,335.47份。

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68000052号验资报告予以验证。本基金为契约型定期开放式基金，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

本财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的要求，真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日的经营成果和基金资产净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与2016年年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

项目	本期末 2017年06月30日
活期存款	1,190,871.33
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	1,190,871.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	62,171,185.98	59,727,017.40
	银行间市场	49,280,765.27	47,068,800.00
	合计	111,451,951.25	106,795,817.40
			-2,444,168.58
			-2,211,965.27
			-4,656,133.85

资产支持证券	34,222,732.19	34,222,732.19	—
其他	—	—	—
合计	145,674,683.44	141,018,549.59	-4,656,133.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末，未持有任何衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	49,700,554.55	—
合计	49,700,554.55	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末，未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末:2017年06月30日
应收活期存款利息	461.10
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	876.48
应收债券利息	2,948,003.12
应收买入返售证券利息	130,786.73
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	626,956.71
合计	3,707,084.14

注：其他为资产支持证券利息。

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	3,744.16
银行间市场应付交易费用	7,370.88
合计	11,115.04

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	84,302.56
合计	84,302.56

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (浙商汇金聚利一年定期A)	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	99,764,847.60	99,764,847.60
本期申购	—	—
本期赎回	—	—
期末数	99,764,847.60	99,764,847.60
项目 (浙商汇金聚利一年定期C)	基金份额（份）	账面金额
上年度末	111,624,335.47	111,624,335.47
本期申购	—	—
本期赎回	—	—
期末数	111,624,335.47	111,624,335.47

注：1、本基金合同于2016年8月1日生效。基金合同生效日的基金份额总额为211,389,183.07份基金

份额，其中认购资金利息折合16,212.89份基金份额。

2、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目 (浙商汇金聚利一年定期A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,185,993.85	-2,466,016.33	-1,280,022.48
本期利润	836,918.32	268,100.08	1,105,018.40
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,022,912.17	-2,197,916.25	-175,004.08

单位：人民币元

项目 (浙商汇金聚利一年定期C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,140,530.72	-2,755,631.13	-1,615,100.41
本期利润	716,483.38	297,413.53	1,013,896.91
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,857,014.10	-2,458,217.60	-601,203.50

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
活期存款利息收入	6,776.74
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	9,995.12
其他	47.53
合计	16,819.39

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期末未进行股票投资。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-3,326,963.22
债券投资收益——赎回差价 收入	—
债券投资收益——申购差价 收入	—
合计	-3,326,963.22

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
卖出债券(、债转股及债券到	105,316,527.14

期兑付)成交总额	
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	103,974,319.01
减:应收利息总额	4,669,171.35
买卖债券差价收入	-3,326,963.22

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期末进行贵金属投资。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期末进行贵金属投资。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期末进行贵金属投资。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期末进行贵金属投资。

6.4.7.14 衍生工具收益

注:本基金在本报告期末进行衍生工具投资。

6.4.7.14.0 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期末进行衍生工具投资。

6.4.7.15 股利收益

本基金在本报告期内无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期
------	----

	2017年01月01日-2017年06月30日
1.交易性金融资产	565,513.61
——股票投资	—
——债券投资	565,513.61
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	565,513.61

6.4.7.17 其他收入

本基金在本报告期无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
交易所市场交易费用	8,750.43
银行间市场交易费用	725.00
合计	9,475.43

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
其他	18,601.80
合计	102,904.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浙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：以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行股票交易,本基金合同生效日为2016年8月1日,无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易,本基金合同生效日为2016年8月1日,无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.3 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	8,705.64	100.00%	3,744.16	100.00%

注：本基金合同生效日为2016年8月1日,无上年度同期对比数据。

上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基

金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.1.4 债券交易

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		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30 日	
	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 成交总额的 比例
浙商证券股份 有限公司	43,752,150.00	100.00%		—

注：本基金合同生效日为2016年8月1日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.5 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		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30 日	
	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例
浙商证券股份 有限公司	440,000,000.00	100.00%	—	—

注：本基金合同生效日为2016年8月1日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	724,981.58	—

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

注：本基金合同生效日为2016年8月1日，无上年度同期对比数据。

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

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	上年度可比期间 2016年01月01日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	207,137.58	—

注：本基金合同生效日为2016年8月1日，无上年度同期对比数据。

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.3 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01月01日-2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浙商汇金聚利一年 定期A	浙商汇金聚利一年 定期C	合计

浙商证券	—	218,485.26	218,485.26
------	---	------------	------------

注：本基金合同生效日为2016年8月1日，无上年度同期对比数据。

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。销售服务费的计提方法如下： $H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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划出，由基金管理人根据相关协议分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未通过银行间同业市场与关联方进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

浙商汇金聚利一年定期A:无。

浙商汇金聚利一年定期C:无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行 活期存款	1,190,871.33	6,776.74

注：本基金合同生效日为2016年8月1日，无上年度同期对比数据。本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

浙商汇金聚利一年定期A:本报告期内未进行利润分配。浙商汇金聚利一年定期C:本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截止本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

截止本报告期末，本基金未持有股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金未持有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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照全面风险管理的要求，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

公司建立了"董事会-经营管理层-合规风控部"三级风险管理体系，董事会主要负责设定公司的风险偏好和制订风险管理授权体系；公司经营层主要负责执行经董事会批准的风险管理政策；合规风控部具体履行合规与风险管理职能，对各类风险进行评估和动态监控。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行，因而与该银行存款相关的信用风险较小。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
A-1	0	9,998,000.00
A-1以下	—	—
未评级	—	—
合计	0	9,998,000.00

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
AAA	49483017.4	68,115,502.06
AAA以下	57312800	160,726,930.13
未评级	—	—
合计	106795817.4	228,842,432.19

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除7.4.12列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2017年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,190,871.33	—	—	—	—	—	1,190,871.33
结算备付金	15,649,228.66	—	—	—	—	—	15,649,228.66
存出保证金	70.79	—	—	—	—	—	70.79
交易性金融资产	1,042,009.60	25,102,000.00	114,874,539.99	—	—	—	141,018,549.59
买入返售金融资产	49,700,554.55	—	—	—	—	—	49,700,554.55
应收利息	—	—	—	—	—	3,707,084.14	3,707,084.14
资产总计	67,582,734.93	25,102,000.00	114,874,539.99	—	—	3,707,084.14	211,266,359.06
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	120,113.11	120,113.11
应付托管费	—	—	—	—	—	34,318.01	34,318.01
应付销售服务费	—	—	—	—	—	403,534.85	403,534.85

应付交易费用	—	—	—	—	—	11,115.04	11,115.04
其他负债	—	—	—	—	—	84,302.56	84,302.56
负债总计	—	—	—	—	—	653,383.57	653,383.57
利率敏感度缺口	67,582,734.93	25,102,000.00	114,874,539.99	—	—	3,053,700.57	210,612,975.49
上年度末 2016年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,472,329.11	—	—	—	—	—	1,472,329.11
结算备付金	386,110.21	—	—	—	—	—	386,110.21
存出保证金	11,747.46	—	—	—	—	—	11,747.46
交易性金融资产	32,437,340.00	21,405,000.00	190,585,014.99	—	—	—	244,427,354.99
应收利息	—	—	—	—	—	5,701,051.98	5,701,051.98
资产总计	34,307,526.78	21,405,000.00	190,585,014.99	—	—	5,701,051.98	251,998,593.75
负债							
卖出回购金融资产款	42,959,755.06	—	—	—	—	—	42,959,755.06
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	123,938.31	123,938.31
应付托管费	—	—	—	—	—	35,410.95	35,410.95
应付销售服务费	—	—	—	—	—	185,098.19	185,098.19
应付交易费	—	—	—	—	—	14,109.6	14,109.6

用						4	4
应付利息	—	—	—	—	—	16,221.4 2	16,221.4 2
其他负债	—	—	—	—	—	170,000. 00	170,000. 00
负债总计	42,959,7 55.06	—	—	—	—	544,778. 51	43,504,5 33.57
利率敏感度 缺口	-8,652,2 28.28	21,405,0 00.00	190,585, 014.99	—	—	5,156,27 3.47	208,494, 060.18

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额；		
假设	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化；		
假设	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	利率下降25个基点	579,261.7400	1,506,064.2300
	利率上升25个基点	-579,261.7400	-1,506,064.2300

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波

动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	106,795,817.40	50.71	210,204,622.80	100.82
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	106,795,817.40	50.71	210,204,622.80	100.82

注：本基金主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产
----	----	----	--------

			的比例 (%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	141,018,549.59	66.75
	其中：债券	106,795,817.40	50.55
	资产支持证券	34,222,732.19	16.20
3	贵金属投资		—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	49,700,554.55	23.53
	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	16,840,099.99	7.97
6	其他资产	3,707,154.93	1.75
7	合计	211,266,359.06	100.00

7.2 期末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	—	—
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	—	—
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	—	—

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

截止本报告期末，本基金未持有股票投资组合。

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

截止本报告期末，本基金未持有股票投资组合。

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

截止本报告期末，本基金未持有股票投资组合。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

截止本报告期末，本基金未持有股票投资组合。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,042,009.60	0.49
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	105,479,300.00	50.08
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	274,507.80	0.13
7	其他	—	—

8	合计	106,795,817.40	50.70
---	----	----------------	-------

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	131117	恒浩航B	150,000	15,174,230.13	7.20
2	127505	16榕经开债	150,000	15,000,000.00	7.12
3	136073	15云能02	150,000	14,596,500.00	6.93
4	1380295	13虞新区债	140,000	11,629,800.00	5.52
5	1580017	15新郑债02	100,000	10,291,000.00	4.89

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	131117	恒浩航B	150,000	15,174,230.13	7.20
2	142212	16云水08	100,000	10,011,090.42	4.75
3	131650	曼听公园05	90,000	9,037,411.64	4.29

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.10.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

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前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

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	70.79
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,707,084.14
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,707,154.93

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有股票。

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

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
浙商汇金聚利一年定期A	848	117,647.23	—	—	99,764,847.60	100.00%
浙商汇金聚利一年定期C	1,160	96,227.88	—	—	111,624,335.47	100.00%
合计	2,008	105,273.50	—	—	211,389,183.07	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	浙商汇金聚利一年定期A	19,986.34	0.01%
	浙商汇金聚利一年定期C	—	—
	合计	19,986.34	0.01%

8.3 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	浙商汇金聚利一年 定期A	0
	浙商汇金聚利一年 定期C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	浙商汇金聚利一年 定期A	0
	浙商汇金聚利一年 定期C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	浙商汇金聚利一年定 期A	浙商汇金聚利一年定 期C
基金合同生效日(2016年08月01日) 基金份额总额	99,764,847.60	111,624,335.47
本报告期期初基金份额总额	99,764,847.60	111,624,335.47
本报告期基金总申购份额	—	—
减：本报告期基金总赎回份额	—	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	99,764,847.60	111,624,335.47

§ 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 基金改聘会计师事务所情况

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监管部门稽查或处罚的情况

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：

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	
浙商证券	2	—	—	43,752,150.00	100.00%	440,000.00	100.00%	—	—	8,705.64	100.00%	
华创证券	1		—		—		—		—	—	—	

注：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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金年度最后一个市场自然日净值公告	公司网址、中国证券报	2017-01-03
2	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加浙商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网址、中国证券报	2017-01-14
3	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网址、中国证券报	2017-01-14
4	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网址、中国证券报	2017-01-14
5	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加上海汇付金融有限公司申购费率优惠活动的公告	公司网址、中国证券报	2017-01-14
6	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加东吴证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	公司网址、中国证券报	2017-01-14
7	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加大泰金石投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	公司网址、中国证券报	2017-01-14

8	浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金2016年第4季度报告	公司网址、中国证券报	2017-01-21
9	关于增加利得基金为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下开放式基金销售机构的公告	公司网址、中国证券报	2017-01-23
10	关于增加华阳众惠为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下开放式基金销售机构的公告	公司网址、中国证券报	2017-02-10
11	关于增加平安证券为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下开放式基金销售机构的公告	公司网址、中国证券报	2017-02-27
12	浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2017年第1号）	公司网址	2017-03-21
13	浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第1号）	公司网址、中国证券报	2017-03-21
14	浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金2016年年度报告摘要	公司网址、中国证券报	2017-03-31
15	浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金2016年年度报告	公司网址	2017-03-31
16	浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金2017年第1季度报告	公司网址、中国证券报	2017-04-21
17	浙江浙商证券资产管理有限公司关于办公地址变更的公告	公司网址、中国证券报	2017-05-02
18	浙江浙商证券资产管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下基金销售机构的公告	公司网址、中国证券报	2017-05-02
19	关于增加国金证券为浙江浙商证	公司网址、中国证券报	2017-06-19

	券资产管理有限公司旗下开放式 基金销售机构的公告		
--	-----------------------------	--	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准设立浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金的文件；
《浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
《浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查询；亦可通过公司网站查阅，公司网址为：
www.stocke.com.cn。

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