

浙商汇金中证转型成长指数型
证券投资基金说明书（更新）

（摘要）

（2017 年第 2 号）

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

一、基金合同的生效日期

浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由浙江浙商证券资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督管理委员会2016年7月19日证监许可[2016] 2726号准予注册。本基金的基金合同自2016年12月19日正式生效。

二、重要提示

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为股票指数型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其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。本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、股指期货投资风险、管理风险、操作风险、技术风险和不可抗力风险等等。投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩亦不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

投资者应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构认/申购和赎回基金，基金销售机构名单详见本招募说明书以及相关公告。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本招募说明书中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为2017年12月18日，有关财务数据截止日为2017年9月30日。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：浙江浙商证券资产管理有限公司

住所：浙江省杭州市下城区天水巷 25 号

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 7 楼

法定代表人：李雪峰

设立日期：2013 年 4 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2012]1431 号

联系电话：（0571）87901590

联系人：金瓚

（二）注册资本和股权结构

1、注册资本：5 亿元人民币

2、股权结构

股东名称	持股占总股本比例
浙商证券股份有限公司	100%

（三）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

（1）董事会

吴承根先生，董事长，硕士。1983 年 7 月至 2006 年 1 月先后在中国人民银

行浙江省分行、国家外汇管理局浙江分局、浙江省人民政府证券期货监管办公室、中国证监会浙江监管局工作；2006年2月至2006年6月任浙江省人民政府金信证券重组工作组常务副组长；2007年1月至今在浙商证券股份有限公司工作，现任浙商证券股份有限公司董事长、浙江浙商证券资产管理有限公司董事长、浙商期货有限公司董事长、浙江浙商资本管理有限公司董事长。

李雪峰先生，董事，总经理，硕士。中国证券业协会资产管理业务专业委员会副主任委员，上海市系统工程学会副理事长。1991年9月至1994年9月在江苏南通柴油机股份有限公司工作；1997年3月至2002年8月任申银万国证券研究所资深高级分析师；2002年9月至2005年5月任渤海证券有限责任公司研究所所长；2005年6月至2008年7月任国都证券有限责任公司部门总经理。2008年8月起在浙商证券股份有限公司工作。现任浙商证券股份有限公司副总裁及董事会秘书、浙江浙商证券资产管理有限公司董事及总经理、浙江浙商资本管理有限公司董事。

王青山先生，董事，硕士。曾任浙江省交通投资集团财务有限公司副总经理、总经理。2015年12月至今任浙江沪杭甬高速公路股份有限公司党委委员，现任浙商证券股份有限公司总裁、浙江浙商证券资产管理有限公司董事、宁波股权交易中心董事长、浙江浙商创新资本管理公司董事长、浙江大数据交易中心董事。

高玮女士，董事，博士。1996年6月至2006年6月任财通证券经纪有限责任公司（原浙江财政证券公司）电脑中心副经理、市场管理总部经理、稽核部经理、职工监事。2006年7月起在浙商证券股份有限公司工作。现任浙商证券股份有限公司副总裁及首席风险官、浙江浙商证券资产管理有限公司董事、浙商期货有限公司董事、浙江浙商资本管理有限公司董事。

楼小平先生，董事，副总经理，硕士。历任申银万国证券嘉兴营业部总经理、申银万国证券宁波第二营业部总经理、申银万国证券杭州营业部总经理、中富证券公司总裁助理兼浙江业务总部总经理、浙商证券创新业务总部总经理、运保中心总经理、本公司私募投行总部总经理。现任浙江浙商证券资产管理有限公司董事、副总经理。

（2）监事

冯建兰女士，1964年7月出生，本科，曾历任义乌市人民银行、义乌市工

商银行副主任，金信证券义务营业部财务部经理，金信证券财务总部副总经理，浙商证券客户资产存管总部总经理。现任浙江浙商证券资产管理有限公司监事、浙商证券股份有限公司计划财务部总经理。

（3）高级管理人员

吴承根，董事长，简历参见上述董事会成员基本情况。

李雪峰，董事，总经理，简历参见上述董事会成员基本情况。

楼小平，董事，副总经理，简历参见上述董事会成员基本情况。

方斌，合规风控总监，硕士。2002年7月至2006年4月曾任职于浙江天健会计师事务所。2006年4月至2015年9月在中国证监会浙江监管局机构监管处、上市监管处任职。2015年10月至2017年7月曾任中融基金管理有限公司总经理助理。2017年7月起担任浙江浙商证券资产管理有限公司合规风控副总监。自2017年11月7日起任浙江浙商证券资产管理有限公司合规风控总监。

2、本基金基金经理

宫幼林先生，计算机科学与技术专业学士和硕士学位，8年基金、证券从业经历。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。自2016年12月19日起任浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金的基金经理。

3、基金管理人采取集体投资决策制度，公司公募基金投资执行委员会成员构成如下：总经理李雪峰，合规风控总监方斌，总经理助理兼公募基金部行政负责人周涛，研究部行政负责人王翊，财富管理总部行政负责人余春梅，基金经理宫幼林。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

四、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

成立日期：1992年6月18日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095 亿元人民币

法定代表人：唐双宁

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75 号

投资与托管业务部总经理：曾闻学

电话：(010) 63636363

传真：(010) 63639132

网址：www.cebbank.com

（二）投资与托管业务部部门及主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长、中国人民银行沈阳市分行行长，中国人民银行信贷管理司司长、货币金银局局长、银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会副主席，中国光大（集团）总公司董事长、党委书记等职务。现任十二届全国人大农业与农村委员会副主任，十一届全国政协委员，中国光大集团股份公司董事长、党委书记，中国光大集团有限公司董事长，兼任中国光大银行股份有限公司董事长、党委书记，中国光大控股有限公司董事局主席，中国光大国际有限公司董事局主席。

行长张金良先生，曾任中国银行财会部会计制度处副处长、处长、副总经理兼任 IT 蓝图实施办公室主任、总经理，中国银行北京市分行行长、党委书记，中国银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司执行董事、党委委员，兼任中国光大银行执行董事、行长、党委副书记。

曾闻学先生，曾任中国光大银行办公室副总经理，中国光大银行北京分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部总经理。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2017 年 9 月 30 日，中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银创新动力混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)、工银瑞信丰实三年定期开放债券型证券投资基金等共 89 只证券投资基金，托管基金资产规模 2126.48 亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企

业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

（1）浙江浙商证券资产管理有限公司直销柜台

住所：杭州市下城区天水巷 25 号

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 7 楼

法定代表人：李雪峰

联系人：芦银洁

联系电话：（0571）87902036

传真：（0571）87902581

网址：www.stocke.com.cn

客服电话：95345

（2）浙江浙商证券资产管理有限公司直销网上交易平台

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 7 楼

联系人：芦银洁

联系电话：（0571）87902036

传真：（0571）87902581

网址：<https://fund.stocke.com.cn/etrading/>

（3）、其他销售机构

1) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市五星路 201 号浙商证券大楼

办公地址：浙江省杭州市五星路 201 号浙商证券大楼

法定代表人：吴承根

联系电话：（0571）87901963

传真：（0571）87901955

网址：www.stocke.com.cn

2) 中国光大银行股份有限公司

住所：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：北京市西城区太平桥大街 25 号

法定代表人：唐双宁

电话：010-63636150

传真：010-6363157

联系人：薛军丽

客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

3) 中国工商银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客服电话：95588

4) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

客服电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

5) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3 号楼 C 座 9 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

6) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

7) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行 25 层 IJ 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

8) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：鲍东华

客服电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

9) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客服电话：400-928-2266

网址：www.dtfunds.com

10) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

办公地址：江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

客服电话：953309

网址：www.dwjq.com.cn

11) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

客服电话：400-067-6266

网址：www.leadfund.com.cn

12) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

13) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：詹露阳

客户电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

14) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区 100 号 19 层

办公地址：上海市黄浦区 100 号 19 层

法定代表人：冯修敏

客服电话：400-820-2819

网址：www.chinapnr.com

15) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

法定代表人：梁越

客服电话：4008980618

网址：www.chtfund.com

16) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

客服电话：95561

网址：www.cib.com.cn

17) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

法定代表人：林卓

客户服务热线：400-0411-001

网址：www.taichengcaifu.com

18) 上海朝阳永续基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人：廖冰

客户服务热线：400-699-1888

网址：www.998fund.com

19) 国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务热线：95310

网址：www.gjzq.com.cn

20) 上海云湾投资管理有限公司

办公地址：上海浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼

法定代表人：戴新装

客户服务热线：4008201515

网址：www.zhengtongfunds.com

21) 南京苏宁基金销售有限公司

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1 号

法定代表人：刘汉青

客户服务热线：95177

网址: www.snjijin.com

22) 上海联泰资产管理有限公司

办公地址: 上海长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人: 燕斌

客户服务热线: 400-166-6788

网址: www.66zichan.com

23) 珠海盈米财富管理有限公司

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场

南塔 1201-1203 室

法定代表人: 肖雯

客户服务热线: 020-89629066

网址: www.yingmi.cn

(二) 登记机构

名称: 浙江浙商证券资产管理有限公司

住所: 浙江省杭州市下城区天水巷 25 号

法定代表人: 李雪峰

电话: 0571-87901972

传真: 0571-87902581

联系人: 俞绍锋

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称: 浙江天册律师事务所

住所: 浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 11 楼

办公地址: 浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 11 楼、8 楼

负责人: 章靖忠

电话: (0571) 87901111

传真: (0571) 87901501

联系人: 俞晓瑜

经办律师：刘斌、俞晓瑜

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市西城区裕民路 18 号北环中心 22 层

办公地址：北京市西城区裕民路 18 号北环中心 22 层

执行事务合伙人：陈胜华

电话：（010）82250666

联系人：张庆栾

经办会计师：张庆栾、李鑫

六、基金的名称

浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金

七、基金的类型

股票型证券投资基金

八、基金的投资目标

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。

九、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证转型成长指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、债券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人

在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 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，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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

十、基金的投资策略

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证转型成长指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、债券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 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，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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

十一、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：#

$95\% \times \text{中证转型成长指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$

十二、基金的风险收益特征

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。

十三、基金的投资组合报告

以下投资组合报告数据截至 2017 年 9 月 30 日。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	98,482,448.47	90.80
	其中：股票	98,482,448.47	90.80
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	7,362,136.80	6.79
8	其他资产	2,610,717.95	2.41
9	合计	108,455,303.22	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,103,908.00	1.03

B	采矿业	6,640,900.00	6.17
C	制造业	56,927,568.58	52.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	2,252,642.00	2.09
F	批发和零售业	5,794,284.00	5.38
G	交通运输、仓储和邮政业	5,618,316.00	5.22
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,307,088.00	3.07
J	金融业	1,043,415.00	0.97
K	房地产业	11,977,364.84	11.13
L	租赁和商务服务业	1,121,063.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	1,092,180.00	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,302,619.00	1.21
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	98,181,348.42	91.20

2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	257,230.56	0.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.03
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	12,776.05	0.01
S	综合	—	—
	合计	301,100.05	0.28

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

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

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	002110	三钢闽光	112,700	1,764,882.00	1.64
2	000006	深振业A	157,000	1,546,450.00	1.44
3	000838	财信发展	189,700	1,375,325.00	1.28
4	300355	蒙草生态	100,900	1,302,619.00	1.21
5	600966	博汇纸业	179,500	1,297,785.00	1.21
6	002067	景兴纸业	176,900	1,280,756.00	1.19
7	000546	金圆股份	91,100	1,271,756.00	1.18
8	000078	海王生物	195,500	1,264,885.00	1.17
9	000789	万年青	146,400	1,257,576.00	1.17
10	600711	盛屯矿业	118,900	1,256,773.00	1.17

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

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	002900	哈三联	1,983	83,087.70	0.08
2	002901	大博医疗	1,834	49,206.22	0.05
3	300700	岱勒新材	833	43,440.95	0.04
4	002906	华阳集团	2,386	32,664.34	0.03
5	002893	华通热力	1,176	31,093.44	0.03

4 报告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。

5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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 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

本基金本报告期末进行贵金属投资。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 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持有股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 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。

10.2 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。

11 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	139,132.76
2	应收证券清算款	2,463,744.57
3	应收股利	—
4	应收利息	1,761.16
5	应收申购款	6,079.46
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,610,717.95

11.4 报告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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002110	三钢闽光	1,764,882.00	1.64	重大资产重组
2	000006	深振业A	1,546,450.00	1.44	重大资产重组

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

11.6 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。

十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

以下基金业绩数据截至 2017 年 9 月 30 日。

1、基金净值表现

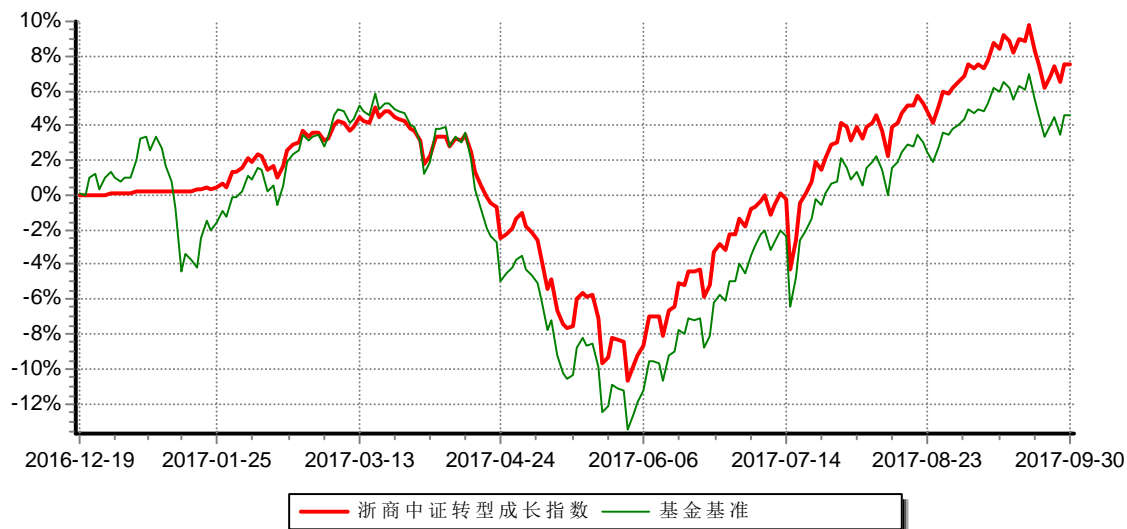
1.1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 浙商汇金中证转型成长指数型

阶段	净值增长率①	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
2016 年 12 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	0.10%	0.03%	1.06%	0.51%	-0.96%	-0.48%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 30 日	7.49%	0.82%	3.48%	1.00%	4.01%	-0.18%
2016 年 12 月 19 日(基金合同生效日)至 2017 年 9 月 30 日	7.60%	0.80%	4.58%	0.98%	3.02%	-0.18%

注：本基金的业绩比较基准：本基金业绩比较基准为：95%×中证转型成长指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

1.2 自基金合同生效以来基金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：本基金合同生效日为2016年12月19日，距本报告期末未满一年，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

十五、费用概览

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 1、基金管理人的管理费

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。

2、基金托管人的托管费

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托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02%的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费按季支付。根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 50,000 元（即不足 50,000 元部分按照 50,000 元收取）。但基金合同生效当季，标的指数许可使用费不设下限，按实际计提的金额支付。

如与指数编制方的指数使用许可协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行，此项变更无需召开基金份额持有人大会。

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

（五）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致并签订补充协议后，可根据基金发展情况调整基金管理费和基金托管费等相关费率。

调低基金管理费率和基金托管费率等，无需召开份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前 2 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

十六、对招募说明书更新部分的说明

管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》

及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、“三、基金管理人”部分，对基金管理人主要人员情况等内容进行了更新。

3、“四、基金托管人”中，对基金托管人的相关信息进行了更新。

4、“五、相关服务机构”部分，对销售机构相关信息进行了更新。

5、“十、基金的投资”部分，列示了本基金最近一期投资组合报告的内容。

6、增加了“十一、基金的业绩”部分，列示了基金合同生效以来的投资业绩。

7、“二十三、其它应披露事项”部分进行了更新，内容为报告期内应披露的本基金其他相关事项。

浙江浙商证券资产管理有限公司

2018年1月31日