

浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告摘要

2017年12月31日

基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金财务出具了无保留意见的审计报告。

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。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇金浙商鼎盈
基金主代码	169201
基金运作方式	<p>契约型</p> <p>基金合同生效后，本基金设一个18个月的封闭期，本基金封闭期自《基金合同》生效之日起（包括《基金合同》生效之日）至18个月（含第18个月）后对应日（遇非工作日顺延至下一个工作日）止，如该日不存在对应日期的，则延后至下一日。</p> <p>本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额；封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金，并更名为浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF），投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。</p>
基金合同生效日	2016年12月7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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	227,359,922.24
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年3月16日

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>在封闭期内，本基金主要投资于定向增发的证券，基金管理人在严格控制风险的前提下，通过对定向增发证券投资价值的深入分析，力争基金资产的长期稳定增值。</p> <p>转为上市开放式基金（LOF）后，本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的基础上，挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下的事件</p>
------	---

	性投资机会，力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	在本基金封闭期内，本基金通过对宏观经济、中观行业分析与定向增发项目优势的深入研究，优选具有较高折价保护并且通过定向增发能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资，形成以定向增发为核心的投资策略，力求基金资产的长期稳健增值。本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，本基金将在宏观经济、中观行业分析的基础上，积极寻找事件驱动下的股票二级市场投资机会，形成以事件驱动为核心的投资策略，力求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌
	联系电话	0571-87901630
	电子邮箱	fangbin@stocke.com.cn
客户服务电话	95345	95588
传真	0571-87902581	(010) 66105798

2.4 信息披露方式

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

点	
---	--

§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7日- 2016年12月31日
本期已实现收益	-10,745,396.93	-268,583.52
本期利润	-6,217,630.60	33,669.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0273	0.0001
本期加权平均净值利润率	-2.80%	0.01%
本期基金份额净值增长率	-2.73%	0.01%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	-11,013,972.57	-268,583.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0484	-0.0012
期末基金资产净值	221,175,967.38	227,393,818.07
期末基金份额净值	0.9728	1.0001
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	-2.72%	0.01%

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

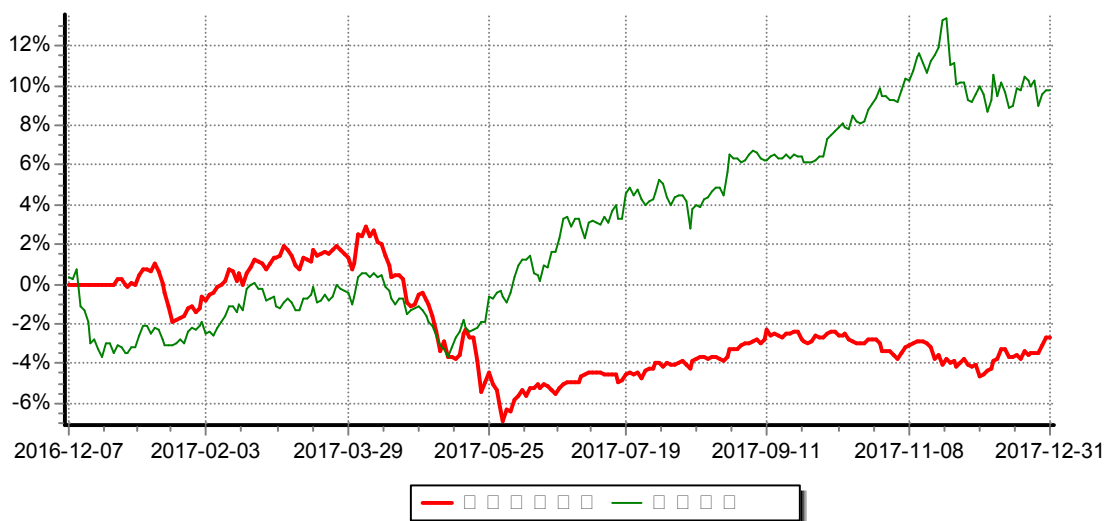
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-0.05%	0.24%	3.11%	0.56%	-3.16%	-0.32%

过去六个月	2.31%	0.21%	6.32%	0.49%	-4.01%	-0.28%
过去一年	-2.73%	0.36%	13.41%	0.45%	-16.14%	-0.09%
自基金合同生效日起 至今（2016年12月 07日-2017年12月31日）	-2.72%	0.34%	9.79%	0.46%	-12.51%	-0.12%

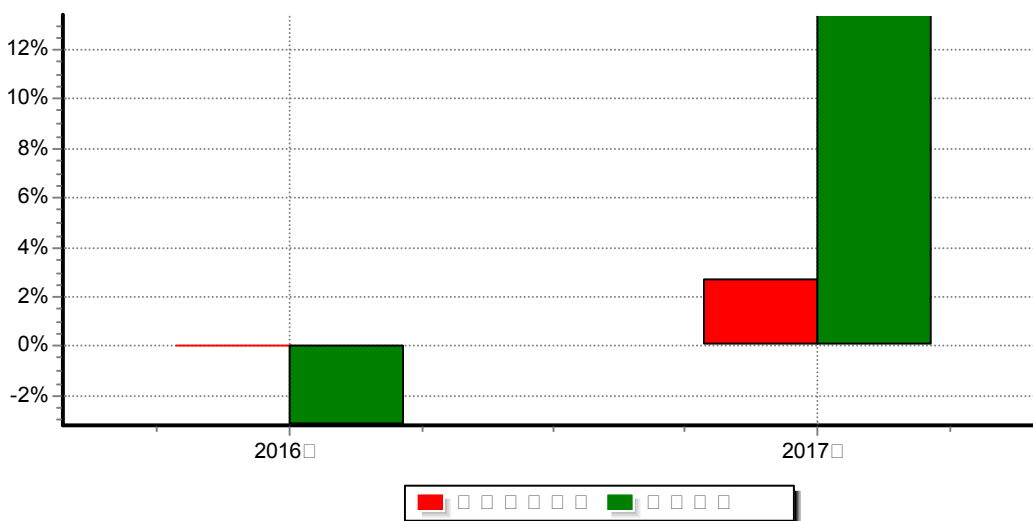
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年12月7日-2017年12月31日)



注：本基金合同生效日为2016年12月7日。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。

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



注：本基金合同生效日为2016年12月7日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金生效以来，按照合同约定，无利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浙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12月31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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵语涛	本基金基金经理；浙商汇金转型成长基金和浙商汇金转型升级基金基金经理。	2016年12月7日	—	9年	博士，曾任东海证券有限责任公司研究所研究员；海通证券股份有限公司资产管理部研究员；兴业基金管理有限公司研究员；浙江浙商证券资产管理有限公司基金经理助理；现任浙商汇金转型成长基金、浙商汇金转型升级基金和浙商汇金鼎盈定增基金基金经理。

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鼎盈定增灵活配置混合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》、《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定制定了公司《公平交易管理办法》。公司公平交易体系涵盖研究分析、投资决策、交易执行、交易监控等投资管理活动相关的各个环节，各环节公平措施简要如下：

公司各投资组合共用研究平台、共享信息，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司接受的外部研究报告、内部研究人员撰写的研究报告对公司各投资组合经理开放。

投资组合经理在授权权限范围内做出投资决策，并负责投资决策的具体实施。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。同时，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度。并在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，交易系统将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。

公司合规风控部定期对不同投资组合交易情况进行分析，对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2017年本基金已根据合同约定，逐步完成产品的配置。定增方面参与了股票定增的投资，其他资产方面也逐步进行了短期国债等品种的配置。未来投资会加强对市场的判断，在现金类资产和权益类中进行优化配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日，本基金份额净值为0.9728元，份额累计净值为0.9728元。报告期内，本基金份额净值增长率为-2.73%，同期业绩基准收益率13.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，国内经济数据方面无论是出口消费这些宏观基本数据，还是房地产库存这些行业数据，整体看基本稳定，目前国内经济出现系统性风险的概率不高。海外方面各经济体开始逐渐将流动性进行收紧，海外尤其是美国的通胀和加息等因素值得密切关注。

市场方面，2017年是行业市值风格重构的一年，对于2018年，我们会结合市场特

点和熟悉的领域进行投资，注重安全边际和性价比，多做立体性思考。

未来的权益类配置方面，消费和先进制造是重要布局点。其他资产类我们会按照合同要求配置短期国债等流动性好的品种。转为上市开放式基金（LOF）后，本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的基础上，挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下的事件性投资机会，力争基金资产的长期稳定增值。

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《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定，本基金在本报告期内未达到基金分配的标准，未进行利润分配。

§ 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，中国工商银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值

的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	[2018]京会兴审字第14020047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	浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金 份额持有人
引言段	我们审计了后附的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“汇金鼎盈定增灵活配置混合型基金”)财务报表，包括2017年12月31日的资产负债表以及2017年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	汇金鼎盈定增灵活配置混合型基金的基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇金鼎盈定增灵活配置混合型基金的持续经营能

	<p>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，除非基金管理人管理层计划清算汇金鼎盈定增灵活配置混合型基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督汇金鼎盈定增灵活配置混合型基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师的责任段</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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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，就可能对汇金鼎盈定增灵活配置混合型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</p>

	<p>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汇金鼎盈定增灵活配置混合型基金不能持续经营。</p> <p>(五) 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>我们与基金管理人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>
<p>审计意见段</p>	<p>我们认为，汇金鼎盈定增灵活配置混合型基金财务报表在所有重大方面按照财政部于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》编制，公允反映了汇金鼎盈定增灵活配置混合型基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况。</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>张庆栾、李 鑫</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市西城区裕民路18号北环中心22层</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2018-02-09</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:			
银行存款		3,672,747.22	4,767,787.95
结算备付金		242,655.73	—
存出保证金		66,017.66	—
交易性金融资产		214,423,763.09	104,975,590.96
其中: 股票投资		46,717,861.59	104,975,590.96
基金投资			
债券投资		167,705,901.50	—
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		—	100,000,000.00
应收证券清算款		—	18,000,010.70
应收利息		3,175,446.99	98,373.60
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		221,580,630.69	227,841,763.21
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		—	—
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		278,769.50	223,618.39

应付托管费		46,461.56	37,269.75
应付销售服务费		—	—
应付交易费用		9,432.25	87,057.00
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		70,000.00	100,000.00
负债合计		404,663.31	447,945.14
所有者权益：			
实收基金		227,359,922.24	227,360,148.23
未分配利润		-6,183,954.86	33,669.84
所有者权益合计		221,175,967.38	227,393,818.07
负债和所有者权益总计		221,580,630.69	227,841,763.21

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值0.9728元，基金份额总额227,359,922.24份。

7.2 利润表

会计主体：浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日-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- 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月7日- 2016年12月31日
一、收入		-229,706.59	491,586.48
1.利息收入		3,887,767.57	188,931.31
其中：存款利息收入		153,468.35	115,299.36
债券利息收入		2,575,562.28	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		1,158,736.94	73,631.95
其他利息收入		—	—

2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,645,240.68	—
其中：股票投资收益		-9,392,921.65	—
基金投资收益			
债券投资收益		213,950.80	—
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		533,730.17	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		4,527,766.33	302,253.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）			
5.其他收入（损失以“-”号填列）		0.19	401.81
减：二、费用		5,987,924.01	457,916.64
1. 管理人报酬		3,330,985.20	223,618.39
2. 托管费		555,164.13	37,269.75
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用		1,861,050.68	96,342.10
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用		240,724.00	100,686.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,217,630.60	33,669.84
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,217,630.60	33,669.84

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日-2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日-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)	227,360,148.23	33,669.84	227,393,818.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-6,217,630.60	-6,217,630.60
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）	-225.99	5.90	-220.09
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	-225.99	5.90	-220.09
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）	227,359,922.24	-6,183,954.86	221,175,967.38
项 目	上年度可比期间 2016年12月7日-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)	—	—	—
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	33,669.84	33,669.84
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）	227,360,148.23	—	227,360,148.23
其中：1.基金申购款	227,360,148.23	—	227,360,148.23

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）	227,360,148.23	33,669.84	227,393,818.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金(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[2016]1634号）《关于准予浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合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《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金合同》向社会公开发行募集。《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为227,360,148.23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68000100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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.4.2 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《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定而编制的。

本财务报表以持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年12月31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 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。

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$ 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。

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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ 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。上述“一、基金费用的种类中第3—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或预提金额来列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在封闭期内，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不得少于1次，年度收益分配比例不得低于基金年度可供分配利润的90%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。转换为上市开放式基金（LOF）后，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%；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。本基金封闭期内的收益分配方式为现金分红。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，基金份额持有人选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式。具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

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。

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。

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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号--公允价值计量》、《企业会计准则第40号--合营安排》、《企业会计准则第41号--在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号--长期股权投资》、《企业会计准则第9号--职工薪酬》、《企业会计准则第30号--财务报表列报》、《企业会计准则第33号--合并财务报表》以及《企业会计准则第37号--金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号--金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

7.4.6 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收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。

7.4.7 关联方关系

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、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
中国工商银行股份有限公司	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。

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日-2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月7日-2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	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	764,622,461.35	62.46%	52,549,677.81	50.20%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日-2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月7日-2016年12月31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	229,097,611.90	81.83%	—	—

	—	—	—	—
--	---	---	---	---

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日-2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月7日-2016年12月31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	3,780,000,000.0 0	100.00%	130,000,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日-2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣 金总额的比例
浙商证券股份 有限公司	758,104.15	69.29%	2,956.50	31.34%
关联方名称	上年度可比期间 2016年12月7日-2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣 金总额的比例
浙商证券股份 有限公司	48,939.33	56.22%	48,939.33	56.22%

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-2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年12月7日-2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,330,985.20	223,618.39
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

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-2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年12月7日-2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	555,164.13	37,269.75

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

本基金于本报告期间及上年度可比期间均未产生销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日-2017年12月31日		2016年12月7日-2016年12月31日	
基金合同生效日（2016年12月7日）持有的基金份额	10,009,350.00		10,009,350.00	
期初持有的基金份额	10,009,350.00		—	
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	10,009,350.00		10,009,350.00	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.40%		4.40%	

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

本报告期末及上年度可比区间，均未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日-2017年12月31日		2016年12月7日-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
中国工商银行活期存款	3,672,747.22	114,780.36	4,767,787.95	115,299.36

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内与上年度可比期间均未参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
002171	楚江新材	2017-01-19	2018-01-20	非公开发行	7.53	7.10	1,196,014	9,000,005.35	8,491,699.40
002171	楚江新材	2017-01-19	2019-01-20	非公开发行	7.53	6.71	1,196,014	9,000,005.35	8,025,253.94
300347	泰格医药	2017-05-12	2018-05-16	非公开发行	24.89	33.47	361,591	8,999,999.99	12,102,450.77
300347	泰格医药	2017-05-12	2019-05-16	非公开发行	24.89	32.28	361,591	8,999,999.99	11,672,157.48

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金在本报告期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

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

			例(%)
1	权益投资	46,717,861.59	21.08
	其中：股票	46,717,861.59	21.08
2	固定收益投资	167,705,901.50	75.69
	其中：债券	167,705,901.50	75.69
	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	3,915,402.95	1.77
7	其他各项资产	3,241,464.65	1.46
8	合计	221,580,630.69	100.00

8.2 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	19,489,853.34	8.81
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	3,453,400.00	1.56
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	23,774,608.25	10.75
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	46,717,861.59	21.12

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300347	泰格医药	723,182	23,774,608.25	10.75
2	002171	楚江新材	2,392,028	16,516,953.34	7.47
3	601333	广深铁路	620,000	3,453,400.00	1.56
4	002465	海格通信	310,000	2,972,900.00	1.34

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601688	华泰证券	26,159,115.98	11.50
2	300347	泰格医药	22,974,029.98	10.10
3	600259	广晟有色	21,565,711.36	9.48
4	600699	均胜电子	20,927,891.05	9.20
5	002171	楚江新材	18,000,010.70	7.92
6	002217	合力泰	16,332,121.15	7.18
7	002138	顺络电子	16,042,224.37	7.05

8	600549	厦门钨业	14,545,243.16	6.40
9	600392	盛和资源	13,986,516.79	6.15
10	600329	中新药业	13,458,819.04	5.92
11	600271	航天信息	13,375,757.50	5.88
12	300188	美亚柏科	10,336,045.00	4.55
13	002108	沧州明珠	9,831,936.40	4.32
14	600416	湘电股份	9,795,435.85	4.31
15	600109	国金证券	9,256,934.96	4.07
16	600089	特变电工	9,007,739.65	3.96
17	600373	中文传媒	8,839,423.00	3.89
18	601601	中国太保	8,647,569.76	3.80
19	600011	华能国际	8,277,271.89	3.64
20	600172	黄河旋风	8,137,745.60	3.58
21	601333	广深铁路	7,974,814.99	3.51
22	600498	烽火通信	7,944,585.32	3.49
23	600118	中国卫星	7,877,697.51	3.46
24	300257	开山股份	7,826,759.18	3.44
25	603108	润达医疗	7,808,855.63	3.43
26	002241	歌尔股份	7,667,657.16	3.37
27	000826	启迪桑德	7,577,246.88	3.33
28	000666	经纬纺机	7,086,531.28	3.12
29	300334	津膜科技	6,999,829.92	3.08
30	600198	大唐电信	6,973,997.75	3.07
31	600366	宁波韵升	6,926,224.65	3.05
32	002250	联化科技	6,908,563.71	3.04
33	601985	中国核电	6,905,797.00	3.04
34	002690	美亚光电	6,648,592.68	2.92
35	000783	长江证券	6,627,271.93	2.91
36	600999	招商证券	6,397,846.00	2.81
37	601788	光大证券	6,386,229.61	2.81
38	600080	金花股份	6,101,456.97	2.68

39	600343	航天动力	5,469,549.67	2.41
40	300332	天壕环境	5,242,304.74	2.31
41	600328	兰太实业	4,951,694.00	2.18
42	000796	凯撒旅游	4,797,553.00	2.11
43	300097	智云股份	4,796,231.71	2.11
44	601628	中国人寿	4,789,185.63	2.11
45	300424	航新科技	4,740,535.04	2.08
46	600562	国睿科技	4,696,712.70	2.07
47	002126	银轮股份	4,686,642.20	2.06
48	002051	中工国际	4,664,438.09	2.05
49	000528	柳 工	4,635,556.35	2.04
50	600585	海螺水泥	4,621,737.00	2.03
51	600258	首旅酒店	4,585,070.50	2.02
52	600977	中国电影	4,558,244.00	2.00
53	002554	惠博普	4,554,509.32	2.00

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601688	华泰证券	26,246,861.70	11.54
2	600259	广晟有色	20,919,837.34	9.20
3	002138	顺络电子	20,643,815.01	9.08
4	600699	均胜电子	19,752,370.04	8.69
5	002217	合力泰	16,829,824.90	7.40
6	600549	厦门钨业	14,412,278.83	6.34
7	600392	盛和资源	13,211,186.00	5.81
8	600271	航天信息	12,945,597.28	5.69
9	600329	中新药业	12,792,203.93	5.63
10	000826	启迪桑德	12,658,398.47	5.57

11	300332	天壕环境	10,861,424.27	4.78
12	300188	美亚柏科	10,250,937.33	4.51
13	002108	沧州明珠	10,204,503.02	4.49
14	600089	特变电工	9,401,476.94	4.13
15	601601	中国太保	9,170,262.82	4.03
16	000820	神雾节能	9,083,366.62	3.99
17	002241	歌尔股份	8,684,449.53	3.82
18	600011	华能国际	8,600,301.20	3.78
19	600080	金花股份	8,480,110.09	3.73
20	600109	国金证券	8,425,534.64	3.71
21	600172	黄河旋风	8,104,888.96	3.56
22	600416	湘电股份	8,060,205.27	3.54
23	600783	鲁信创投	7,838,560.14	3.45
24	600885	宏发股份	7,659,567.98	3.37
25	600118	中国卫星	7,653,594.62	3.37
26	601985	中国核电	7,552,871.00	3.32
27	002026	山东威达	7,468,460.77	3.28
28	600373	中文传媒	7,386,536.00	3.25
29	603108	润达医疗	7,339,749.30	3.23
30	300257	开山股份	7,250,262.00	3.19
31	600498	烽火通信	7,166,493.92	3.15
32	600999	招商证券	7,124,645.91	3.13
33	601788	光大证券	7,059,949.83	3.10
34	000666	经纬纺机	7,053,640.00	3.10
35	000783	长江证券	6,984,791.49	3.07
36	600366	宁波韵升	6,928,475.76	3.05
37	300334	津膜科技	6,750,770.00	2.97
38	002690	美亚光电	6,531,520.58	2.87
39	002250	联化科技	6,476,848.68	2.85
40	600198	大唐电信	5,557,762.98	2.44
41	601628	中国人寿	5,286,907.21	2.33

42	002051	中工国际	5,282,867.93	2.32
43	000811	冰轮环境	5,232,831.00	2.30
44	002589	瑞康医药	5,202,842.40	2.29
45	002126	银轮股份	5,155,066.88	2.27
46	600977	中国电影	5,088,583.08	2.24
47	600343	航天动力	5,059,001.90	2.22
48	600258	首旅酒店	5,016,624.84	2.21
49	600585	海螺水泥	4,900,384.00	2.16
50	601333	广深铁路	4,842,000.00	2.13
51	300347	泰格医药	4,786,246.00	2.10
52	300136	信维通信	4,694,929.03	2.06
53	000528	柳 工	4,625,635.00	2.03
54	600406	国电南瑞	4,598,188.50	2.02
55	600328	兰太实业	4,583,603.00	2.02

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。

8.4.3 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	604,306,293.58
卖出股票的收入（成交）总额	657,696,876.14

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。

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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	146,652,321.50	66.31
2	央行票据	—	—
3	金融债券	21,053,580.00	9.52
	其中：政策性金融债	21,053,580.00	9.52
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—

6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	167,705,901.50	75.82

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	019540	16国债12	214,290	21,300,426.00	9.63
2	019557	17国债03	211,620	21,132,373.20	9.55
3	019504	15国债04	211,700	21,127,660.00	9.55
4	108601	国开1703	211,000	21,053,580.00	9.52
5	019563	17国债09	210,000	20,968,500.00	9.48

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	66,017.66
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,175,446.99
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,241,464.65

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300347	泰格医药	23,774,608.25	10.75	定向增发
2	002171	楚江新材	16,516,953.34	7.47	定向增发

8.12.6 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。

§ 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

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
2,262	100,512.79	33,488,260.81	14.73%	193,871,661.43	85.27%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	天安人寿保险股份有限公司-万能产品	7,783,631.00	3.42%
2	赵本营	3,684,732.00	1.62%
3	赵岩	3,216,800.00	1.41%
4	董昌旺	3,000,058.00	1.32%
5	廖龙	2,000,077.00	0.88%
6	杜阳学	1,500,160.00	0.66%
7	朱洲	1,005,039.00	0.44%
8	武装	1,000,038.00	0.44%
9	倪建良	991,134.00	0.44%
10	王尉平	844,024.00	0.37%

注：上述基金持有人均为场内持有人。

9.3 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	2,913,138.52	1.28%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年12月7日)基金份额总额	227,360,148.23
本报告期期初基金份额总额	227,360,148.23
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	225.99
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	227,359,922.24

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人的重大人事变动：2017年11月,合规风控总监由高玮女士变更为方斌先生。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

基金托管人的专门基金托管部门：无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 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,本报告年度的审计费用为50,000元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内，本基金管理人和托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占股票 成交总额比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
国泰君安	1	459,487,858.66	37.54%	336,023.59	30.71%	
浙商证券	2	764,622,461.35	62.46%	758,104.14	69.29%	

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交易单元进行交易。截至报告期末，本公司已在深圳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。报告期内，我司通过一家证券公司深圳交易所交易单元买卖证券的年交易佣金均未超过当年所有基金在深圳交易所交易单元买卖证券交易佣金30%。本报告期内，交易单元无变更。

b)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、个股分析的报告及丰富全面的信息；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。

11.7.2 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
国泰君安	50,873,159.31	18.17%	—	—	—	—
浙商证券	229,097,611.90	81.83%	3,780,000,000.00	100.00%	—	—

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内未出现其他影响投资者决策的重要信息。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二〇一八年三月三十日