

# 浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券 投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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 2017 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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合规守信情况的说明.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
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
<b>§ 7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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的情况.....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</b>
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.....	55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	浙商大数据智选消费
基金主代码	002967
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 月 11 日
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	361,471,733.45 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过公司自主研发的大数据智选模型进行行业配置和个股选择，在严格控制风险的前提下，力争获取较好的收益。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，在科学分析与有效管理风险的基础上，实现风险与收益的最佳匹配。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中证主要消费行业指数×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 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		浙商基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	田青
	联系电话	021-60350812	010-67595096
	电子邮箱	guoleqi@zsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	010-67595096
传真		0571-28191919	010-66275853
注册地址		浙江省杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		浙江省杭州市西湖区教工路 18 号世贸丽晶欧美中心 B 座 507 室	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		310012	100033

法定代表人	肖风	王洪章
-------	----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.zsfund.com">http://www.zsfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	浙商基金管理有限公司	浙江省杭州市西湖区教工路18号世贸丽晶城欧美中心B座507室

### § 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月11日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-6,485,042.81
本期利润	1,350,700.55
加权平均基金份额本期利润	0.0033
本期加权平均净值利润率	0.33%
本期基金份额净值增长率	0.10%
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	-6,961,641.86
期末可供分配基金份额利润	-0.0193
期末基金资产净值	361,943,091.59
期末基金份额净值	1.001
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	0.10%

#### 3.2 基金净值表现

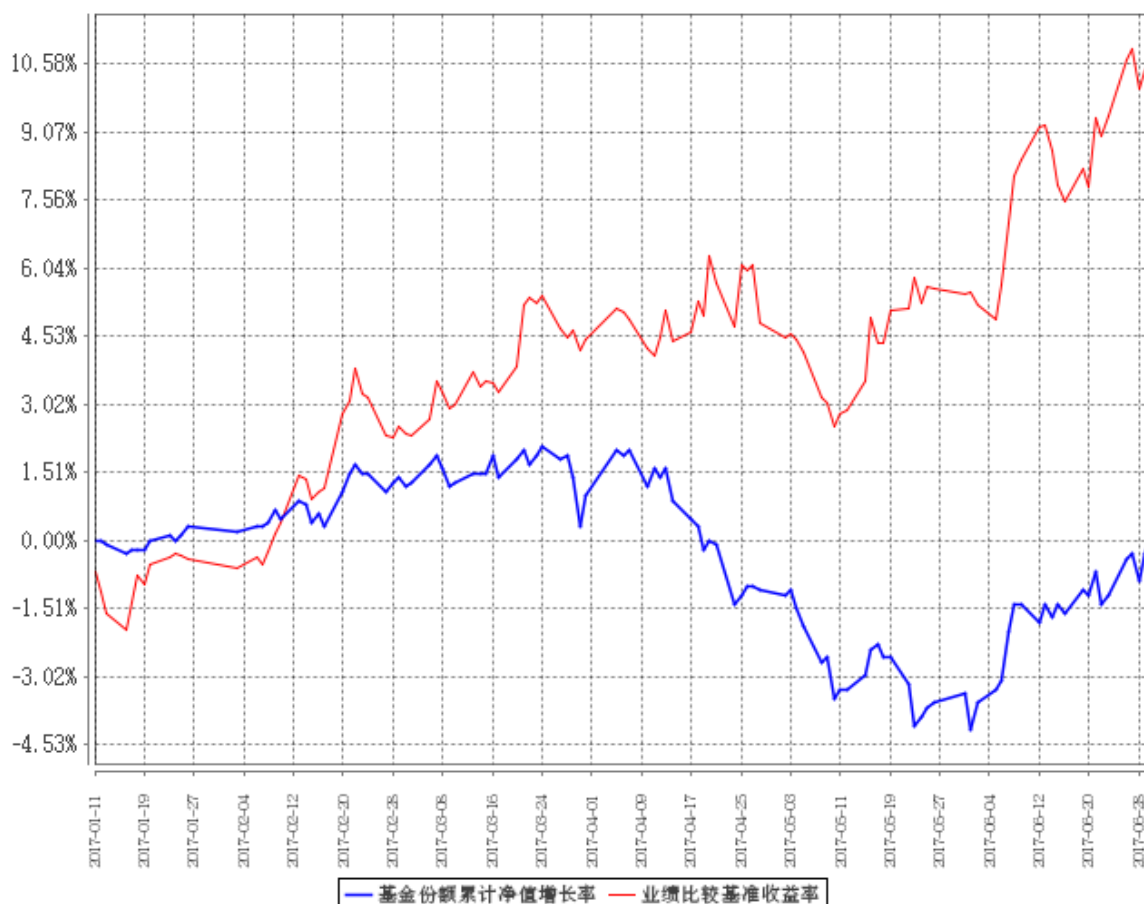
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.62%	0.51%	4.94%	0.64%	-1.32%	-0.13%
过去三个月	-0.89%	0.50%	5.96%	0.62%	-6.85%	-0.12%
自基金合同生效起至今	0.10%	0.42%	10.70%	0.56%	-10.60%	-0.14%



### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2017 年 1 月 11 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间未满一年。

图示日期为 2017 年 1 月 11 日至 2017 年 6 月 30 日。

2、本基金建仓期为 6 个月，至本报告期末未完成建仓，图示日期为 2017 年 1 月 11 日至 2017 年 6 月 30 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浙商基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会(证监许可[2010]1312 号)批准，于 2010 年 10 月 21 日成立。公司股东为浙商证券股份有限公司、通联资本管理有限公司、养生堂有限公司、浙大网新集团有限公司，四家股东各出资 7500 万元，公司注册资本 3 亿元人民币。注册地为浙江省杭州市。

截至 2017 年 6 月 30 日，浙商基金共管理十五只开放式基金——浙商大数据智选消费混合型证券投资基金、浙商沪深 300 指数分级证券投资基金、浙商惠丰定期开放债券型证券投资基金、浙商惠利纯债债券型证券投资基金、浙商惠南纯债债券型证券投资基金、浙商惠享纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、浙商惠裕纯债债券型证券投资基金、浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金、浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合证券投资基金、浙商聚盈信用债债券型证券投资基金、浙商日添利货币市场基金、浙商日添金货币市场基金。

#### 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		
查晓磊	本基金的基金经理，公司衍生品及量化投资部副总经理	2017 年 1 月 11 日	-	6	查晓磊先生，香港中文大学财务学博士。历任博时基金管理有限公司投资策略及大宗商品分析师。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了规范公平交易行为，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规规定，本公司制定了相应的公平交易制度。在投资决策层面，本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，对不同类别的投资组合分别管理、独立决策；在交易层面，实行集中交易制度，建立了公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会，严禁在不同投资

组合之间进行利益输送；在监控和评估层面，本公司金融工程小组将每日审查当天的投资交易，对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，本基金未发生违反公平交易制度的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，基金按照既定策略，利用多维度的大数据体系，试图发现景气向好变化而市场尚未认知的消费细分子行业，获得相应投资收益。策略整体运作基本稳定，在诸如白酒，家电，医药商业，零售等子行业上，得到了后续的基本面验证和市场验证。而在选股层面，行业的具体股票由量化方式确定，具有较高的组合分散性，但这一特点在本季度前半段市场机会极度集中的环境下，遭遇到一定的压力，导致净值出现了一定程度的回撤。在观察市场的这种极端情况后，我们尽力调整基金组合的风险平衡性，努力控制回撤，同时总结经验，以提升我们在未来这种情况下的应对能力。在季度的后半段，市场极端格局逐步缓和，净值也逐步回升。我们持续优化和提升资产配置，行业选择和选股的模型，虽然部分模型阶出现阶段性出现失效，但我们对每个模型的逻辑和数据都重新一一审视，同时审视模型背后的假设和适应的环境，对仍然通过我们筛选标准的模型，我们依然有信心在将来继续发挥作用。

在大数据领域，我们仍然会不断探索和完善，继续沿着数据的广度、频度、深度等方向，寻找对资产管理和投资的最大贡献点。成熟稳定的数据和结果也会不断加入我们大数据量化的策略池中，助力对现有基金表现的提升。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.001 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.10%，业绩比较基准收益率为 10.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历了二月份以后宏观经济阶段性高点有所回落后，以 PMI 为代表的一些指标表征了经济在六月份再次稳定的迹象。最为敏感的大宗商品也有所异动。对未来经济的走势，我们需要结合更多的数据及微观的印证提升我们判断的概率，但有一定基本可以确定，中国经济的韧性是很强的。同时，海外经济，尤其是欧洲的情况，都在同步性的转好，国际贸易复苏也被越来越多的人谈及，当然这些还尚未形成较为一致的预期。

流动性实际上是主导市场短期波动的重要变量。第二季度的加强监管，对市场形成了冲击，但从长期看，一方面是释放了当期的潜在风险，另一方面实际上夯实了未来良性发展的基础。因此，短期的冲击是暂时的，更不能理解为是整体货币政策大幅转向的标志。

市场在接下来对盈利和估值的定价还将很看重。但集中追逐大市值公司的局面可能趋于缓和，规模因素趋于中性。对于消费行业，顺应需求的子行业仍会得到市场积极响应。我们将继续通过多维前瞻的大数据体系，积极努力发现投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作的估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。公司估值委员会成员中不包括基金经理。报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期末未进行收益分配。

#### 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

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 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：浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	17,982,972.01	-
结算备付金		6,976,047.09	-
存出保证金		100,087.25	-
交易性金融资产	6.4.7.2	241,337,844.83	-
其中：股票投资		241,337,844.83	-
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	100,000,000.00	-
应收证券清算款		84,632.69	-
应收利息	6.4.7.5	-24,781.07	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,300.50	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		366,458,103.30	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,999,979.98	-
应付赎回款		1,316,521.46	-
应付管理人报酬		449,819.24	-
应付托管费		74,969.89	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	598,160.30	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	75,560.84	-
负债合计		4,515,011.71	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	361,471,733.45	-
未分配利润	6.4.7.10	471,358.14	-
所有者权益合计		361,943,091.59	-
负债和所有者权益总计		366,458,103.30	-

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.001 元，基金份额总额 361471733.45 份。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 11 日(基 金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		7,276,069.87	-
1. 利息收入		2,621,393.44	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	311,764.38	-
债券利息收入		220,031.53	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,089,597.53	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,641,487.87	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,776,482.04	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	10,100.80	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,124,893.37	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,835,743.36	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	460,420.94	-

<b>减：二、费用</b>		5,925,369.32	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,862,567.92	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	477,094.69	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,505,434.54	-
5. 利息支出		1,808.22	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,808.22	-
6. 其他费用	6.4.7.20	78,463.95	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,350,700.55	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,350,700.55	-

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 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)	488,689,300.96	-	488,689,300.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,350,700.55	1,350,700.55
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)	-127,217,567.51	-879,342.41	-128,096,909.92
其中：1. 基金申购款	3,817,953.36	20,342.89	3,838,296.25
2. 基金赎回款	-131,035,520.87	-899,685.30	-131,935,206.17
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)	361,471,733.45	471,358.14	361,943,091.59



项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]1283号批准,由浙商基金管理有限公司(以下简称“浙商基金公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2017年1月11日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为浙商基金公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

本基金于 2016 年 12 月 12 日至 2017 年 1 月 6 日募集，募集期间净认购资金人民币 488,554,710.72 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 134,590.24 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 488,689,300.96 元。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第 1700134 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等）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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。股票资产占基金资产的比例为 0-95%，投资于消费主题的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于 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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证主要消费行业指数×60%+上证国债指数收益率×40%。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 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颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况、自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动

情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2017年1月1日至2017年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

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

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

##### 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

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

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

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。

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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

#### 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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一基金份额享有同等分配权。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。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。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 6 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。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两

者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 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

本基金在报告期内未发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在报告期内未发生过重大会计差错。

## 6.4.6 税项

根据财税字[1998] 55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002] 128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2015] 101 号《财政部国家税务总局证监会关于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》、财税[2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 自 2016 年 5 月 1 日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2018 年 1 月 1 日(含)以后,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人,按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此,截至 2017 年 6 月 30 日,本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得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,股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的,暂减按 25% 计入应纳税所得额,股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的,暂免征收个人所得税。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得,暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益,由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时,对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税;或发行债券的企业向该内地基金分配利息时,对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税,并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时,不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。



(g) 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。

(h) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	17,982,972.01
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	17,982,972.01

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	233,502,101.47	241,337,844.83	7,835,743.36
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	233,502,101.47	241,337,844.83	7,835,743.36

##### 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6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	100,000,000.00	-
合计	100,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金期末无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6月30日
应收活期存款利息	5,514.20
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	3,139.20
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-33,479.47
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	45.00
合计	-24,781.07

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	598,160.30
银行间市场应付交易费用	-
合计	598,160.30

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,306.50
审计费	24,085.35
信息披露费	48,168.99
合计	75,560.84

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	488,689,300.96	488,689,300.96
本期申购	3,817,953.36	3,817,953.36
本期赎回(以“-”号填列)	-131,035,520.87	-131,035,520.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	361,471,733.45	361,471,733.45

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-6,485,042.81	7,835,743.36	1,350,700.55
本期基金份额交易产生的变动数	-476,599.05	-402,743.36	-879,342.41
其中：基金申购款	13,630.71	6,712.18	20,342.89
基金赎回款	-490,229.76	-409,455.54	-899,685.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,961,641.86	7,433,000.00	471,358.14

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日
活期存款利息收入	236,316.57
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	74,969.53
其他	478.28
合计	311,764.38

## 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日
卖出股票成交总额	709,639,993.30
减：卖出股票成本总额	715,416,475.34
买卖股票差价收入	-5,776,482.04

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月11日(基金合同生效日)至2017年6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	10,100.80
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	10,100.80

## 6.4.7.13.2 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1月11日(基金合同生效日)至2017年 6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交 总额	46,058,902.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付） 成本总额	44,985,899.20
减：应收利息总额	1,062,902.40
买卖债券差价收入	10,100.80

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末持有资产支持证券。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,124,893.37
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,124,893.37

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	7,835,743.36
——股票投资	7,835,743.36
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	7,835,743.36

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日
基金赎回费收入	460,420.94
合计	460,420.94

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,505,434.54
银行间市场交易费用	-
合计	2,505,434.54

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,085.35
信息披露费	48,168.99
其他	360.00
银行汇划费用	5,849.61
合计	78,463.95

**6.4.7.21 分部报告**

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

**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**

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

## 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

-

### 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
浙商基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
建设银行股份有限公司	基金托管人
浙商证券股份有限公司	基金管理人的股东
通联资本管理有限公司	基金管理人的股东
浙江浙大网新集团有限公司	基金管理人的股东
养生堂有限公司	基金管理人的股东
上海聚潮资产管理有限公司	基金管理人的子公司

## 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

本基金自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间没有通过关联方的交易单元进行过交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间没有通过关联方的交易单元进行过交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间没有通过关联方的交易单元进行过交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间没有通过关联方的交易单元进行过交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间没有应支付关联方的佣金。

### 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

项目	本期 2017 年 1 月 11 日(基金合同生	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
----	-----------------------------	---------------------------------



	效日)至 2017 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的管理费	2,862,567.92	-
其中:支付销售机构的客户维护费	1,507,892.22	-

注:支付基金管理人浙商基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值的一定比例计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数(自 2017 年 1 月 11 日(基金合同生效日)起)

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	477,094.69	-

注:支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

#### 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

本基金自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

本基金的管理人自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间未持有过本基金。

##### 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

本基金除管理人之外的其他关联方自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间未持有过本基金。

#### 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 1 月 11 日(基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	17,982,972.01	236,316.57	-	-

注：本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2017 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 6976047.09 元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金在本期间未进行过利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40
603305	旭升	2017 年	2017	新股流	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26

	股份	6月30日	年7月10日	通受限					
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76

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

#### 6.4.12.2 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（股）	期末成本总额	期末估值总额
600559	老白干酒	2017年1月23日	重大资产重组	22.69	-	-	28,800	651,696.82	653,472.00
603501	韦尔股份	2017年6月5日	重大资产重组	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55
000613	*ST东海A	2017年2月15日	重大资产重组	15.04	2017年8月17日	14.29	59	858.33	887.36

### 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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

### 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

本基金为混合型基金，其预期风险和收益高于债券型基金、货币市场基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资及股指期货投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以合规与风险控制委员会为核心的，由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部、金融工程小组和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向合规与风险控制委员会提交独立的监察稽核报告和建议；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与金融工程小组负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

下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负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6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	17,982,972.01	-	-	-	-	-	17,982,972.01
结算备付金	6,976,047.09	-	-	-	-	-	6,976,047.09
存出保证金	100,087.25	-	-	-	-	-	100,087.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	241,337,844.83	241,337,844.83
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	-	-	100,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	84,632.69	84,632.69
应收利息	-	-	-	-	-	-24,781.07	-24,781.07
应收申购款	-	-	-	-	-	1,300.50	1,300.50
资产总计	125,059,106.35	-	-	-	-	241,398,996.95	366,458,103.30
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,999,979.98	1,999,979.98
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,316,521.46	1,316,521.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	449,819.24	449,819.24
应付托管费	-	-	-	-	-	74,969.89	74,969.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	598,160.30	598,160.30
其他负债	-	-	-	-	-	75,560.84	75,560.84
负债总计	-	-	-	-	-	4,515,011.71	4,515,011.71
利率敏感度缺口	125,059,106.35	-	-	-	-	-236,883,985.24	361,943,091.59
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							
负债							

#### 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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6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	241,337,844.83	66.68	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	241,337,844.83	66.68	-	-

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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6月）	上年度末（2016年12月）

		30 日 )	31 日 )
	沪深 300 指数上升 5%	11,753,654.91	-
	沪深 300 指数下降 5%	-11,753,654.91	-

#### 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	241,337,844.83	65.86
	其中：股票	241,337,844.83	65.86
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	100,000,000.00	27.29
	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	24,959,019.10	6.81
7	其他各项资产	161,239.37	0.04
8	合计	366,458,103.30	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	4,723,187.84	1.30
B	采矿业	-	-
C	制造业	115,903,601.19	32.02
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	79,353,564.95	21.92
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	24,025,372.91	6.64
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	9,789,502.00	2.70
K	房地产业	2,323,552.00	0.64
L	租赁和商务服务业	859.52	0.00
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	5,210,564.80	1.44
S	综合	-	-
	合计	241,337,844.83	66.68

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

### 7.3 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	601933	永辉超市	1,164,600	8,245,368.00	2.28
2	000333	美的集团	149,215	6,422,213.60	1.77
3	002345	潮宏基	586,000	6,369,820.00	1.76
4	000524	岭南控股	462,591	6,235,726.68	1.72
5	600754	锦江股份	226,794	6,146,117.40	1.70
6	000587	金洲慈航	400,093	5,961,385.70	1.65
7	600519	贵州茅台	12,600	5,945,310.00	1.64
8	600258	首旅酒店	251,286	5,870,040.96	1.62
9	601007	金陵饭店	494,653	5,772,600.51	1.59
10	000026	飞亚达A	462,548	5,754,097.12	1.59
11	600315	上海家化	176,800	5,737,160.00	1.59
12	000001	平安银行	604,200	5,673,438.00	1.57
13	600887	伊利股份	261,000	5,634,990.00	1.56
14	002574	明牌珠宝	645,626	5,616,946.20	1.55
15	600073	上海梅林	581,600	5,554,280.00	1.53
16	600276	恒瑞医药	109,682	5,548,812.38	1.53
17	600597	光明乳业	408,868	5,213,067.00	1.44
18	300133	华策影视	465,229	5,210,564.80	1.44
19	600400	红豆股份	714,195	4,913,661.60	1.36
20	002470	金正大	644,436	4,852,603.08	1.34
21	002299	圣农发展	317,632	4,723,187.84	1.30
22	000078	海王生物	755,499	4,555,658.97	1.26
23	600109	国金证券	351,200	4,116,064.00	1.14

24	300146	汤臣倍健	293,209	4,028,691.66	1.11
25	603528	多伦科技	245,400	3,526,398.00	0.97
26	600297	广汇汽车	467,366	3,519,265.98	0.97
27	002607	亚夏汽车	754,315	3,447,219.55	0.95
28	002557	洽洽食品	236,039	3,415,484.33	0.94
29	600335	国机汽车	281,941	3,372,014.36	0.93
30	000753	漳州发展	720,795	3,351,696.75	0.93
31	002481	双塔食品	491,800	3,280,306.00	0.91
32	601965	中国汽研	348,757	3,274,828.23	0.90
33	002661	克明面业	198,110	3,215,325.30	0.89
34	601258	庞大集团	1,141,700	3,196,760.00	0.88
35	603866	桃李面包	89,584	3,187,398.72	0.88
36	000501	鄂武商 A	150,172	2,772,175.12	0.77
37	601607	上海医药	93,800	2,708,944.00	0.75
38	603883	老百姓	53,824	2,618,537.60	0.72
39	600998	九州通	120,669	2,601,623.64	0.72
40	600827	百联股份	159,200	2,587,000.00	0.71
41	000028	国药一致	31,500	2,548,350.00	0.70
42	002727	一心堂	135,650	2,495,960.00	0.69
43	601718	际华集团	282,500	2,483,175.00	0.69
44	600694	大商股份	63,176	2,461,968.72	0.68
45	600723	首商股份	271,200	2,419,104.00	0.67
46	600729	重庆百货	89,900	2,412,916.00	0.67
47	600056	中国医药	91,500	2,374,425.00	0.66
48	603808	歌力思	80,400	2,373,408.00	0.66
49	002029	七匹狼	246,930	2,363,120.10	0.65
50	600713	南京医药	334,206	2,349,468.18	0.65
51	600398	海澜之家	246,902	2,343,099.98	0.65
52	600697	欧亚集团	83,157	2,341,701.12	0.65
53	002563	森马服饰	276,113	2,341,438.24	0.65
54	600177	雅戈尔	229,600	2,323,552.00	0.64
55	002419	天虹股份	161,407	2,321,032.66	0.64
56	600327	大东方	281,800	2,307,942.00	0.64
57	000417	合肥百货	278,700	2,299,275.00	0.64
58	002612	朗姿股份	168,800	2,285,552.00	0.63
59	002293	罗莱生活	197,592	2,264,404.32	0.63
60	600829	人民同泰	183,228	2,261,033.52	0.62
61	002462	嘉事堂	57,534	2,260,510.86	0.62
62	603116	红蜻蜓	122,267	2,247,267.46	0.62

63	002589	瑞康医药	139,217	2,143,941.80	0.59
64	601566	九牧王	128,153	2,065,826.36	0.57
65	600559	老白干酒	28,800	653,472.00	0.18
66	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
67	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
68	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
69	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.01
70	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
71	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
72	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
73	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
74	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
75	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
76	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
77	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
78	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
79	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
80	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
81	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
82	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
83	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
84	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
85	000858	五粮液	100	5,566.00	0.00
86	000613	*ST 东海 A	59	887.36	0.00
87	600093	易见股份	64	859.52	0.00

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600315	上海家化	15,921,679.09	3.26
2	600754	锦江股份	14,852,778.67	3.04
3	600597	光明乳业	14,472,416.54	2.96
4	600887	伊利股份	14,270,409.99	2.92
5	002503	搜于特	12,522,968.92	2.56
6	002186	全聚德	11,675,832.53	2.39

7	002776	柏堡龙	11,365,212.27	2.33
8	300459	金科文化	10,906,797.50	2.23
9	002574	明牌珠宝	10,846,271.66	2.22
10	000587	金洲慈航	10,817,906.12	2.21
11	000662	天夏智慧	10,809,359.00	2.21
12	002345	潮宏基	10,779,944.00	2.21
13	002563	森马服饰	10,404,251.76	2.13
14	002481	双塔食品	10,092,283.85	2.07
15	600073	上海梅林	9,772,929.60	2.00
16	603001	奥康国际	9,687,810.07	1.98
17	000333	美的集团	9,677,192.50	1.98
18	000523	广州浪奇	9,514,661.83	1.95
19	002637	赞宇科技	9,503,887.01	1.94
20	600429	三元股份	9,392,036.92	1.92

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002503	搜于特	13,111,180.88	2.68
2	002186	全聚德	11,695,387.10	2.39
3	600315	上海家化	11,342,417.60	2.32
4	002776	柏堡龙	11,234,549.37	2.30
5	000662	天夏智慧	10,692,467.98	2.19
6	300459	金科文化	10,220,864.50	2.09
7	600429	三元股份	9,727,876.49	1.99
8	600597	光明乳业	9,498,565.02	1.94
9	600887	伊利股份	9,394,675.00	1.92
10	000523	广州浪奇	9,358,959.18	1.92
11	002637	赞宇科技	9,152,461.58	1.87
12	603001	奥康国际	9,137,807.77	1.87
13	002770	科迪乳业	9,124,945.74	1.87

14	002563	森马服饰	7,926,620.38	1.62
15	600754	锦江股份	7,542,659.51	1.54
16	002719	麦趣尔	7,369,861.56	1.51
17	603020	爱普股份	6,873,752.48	1.41
18	002507	涪陵榨菜	6,683,018.28	1.37
19	002481	双塔食品	5,947,435.90	1.22
20	603528	多伦科技	5,913,492.00	1.21

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	948,918,576.81
卖出股票收入（成交）总额	709,639,993.30

### 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持有贵金属。

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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没有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、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	100,087.25
2	应收证券清算款	84,632.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-24,781.07
5	应收申购款	1,300.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	161,239.37

### 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换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。



## § 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
2,558	141,310.29	109,996,909.88	30.43%	251,474,823.57	69.57%

### 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	161,478.50	0.04%

### 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的情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年1月11日）基金份额总额	488,689,300.96
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,817,953.36
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	131,035,520.87
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	361,471,733.45

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

2017 年 2 月 15 日，唐生林先生就任浙商基金管理有限公司副总经理职务。  
本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
川财证券	1	682,904,302.32	41.24%	682,914.86	41.42%	-

方正证券	1	349,856,307.54	21.13%	349,856.49	21.22%	-
东方证券	1	341,112,971.22	20.60%	341,112.92	20.69%	-
兴业证券	1	264,376,452.45	15.96%	264,380.95	16.03%	-
光大证券	1	12,326,825.36	0.74%	6,549.16	0.40%	-
东北证券	2	5,494,951.76	0.33%	4,018.62	0.24%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 遵循国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定的要求；
- (2) 维护持有人利益，不利用基金资产进行利益输送，不承诺交易量；
- (3) 以券商服务质量作为席位选择和佣金分配的标准。

2、券商专用交易单元选择程序：

- (1) 投资管理部、市场部

a、专员与券商联系商讨合作意向，根据公司及基金法律文件中对券商席位的选择标准，并参考中央交易室主管的建议，确定新基金租用或基金新租用席位的所属券商以及（主）席位。

b、报公司分管领导审核通过。

- (2) 中央交易室

a、专员将我公司格式版本的《证券交易席位使用协议》发送给券商相关业务联系人。

b、券商对我公司提供的协议有修改意见的，其内容若涉及投资管理部、市场部、运营保障部的，由专员分别将此内容发送给上述部门审议，并由专员将我公司各职能部门反馈的意见与券商进行商议，形成一致意见后完成协议初稿，交我公司监察稽核部审核。

c、对券商和我公司双方同意的协议文本进行签字盖章。我公司盖章程序，由专员填写合同流转单，分别送达投资管理部、市场部、运营保障部、监察稽核部签字，最后盖章。

3、本基金报告期内券商交易单元变更情况：

(1) 新增券商交易单元：长城证券（397417）、兴业证券（000515）、方正证券（33665）、川财证券（002580）、东方证券（37887）、光大证券（38750）、东北证券（38768、003909）、中泰证券（004123）。

(2) 本基金与浙商日添利货币市场基金共用长城证券（397417）、兴业证券（000515）、方正证券（33665）、东方证券（37887）交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
川财证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	44,985,899.20	100.00%	8,317,800,000.00	77.39%	-	-
东方证券	-	-	1,020,000,000.00	9.49%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	600,000,000.00	5.58%	-	-
东北证券	-	-	810,000,000.00	7.54%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浙商大数据智选消费混合型证券投资基金份额发售时间的提示性公告	《证券时报》	2017年1月4日
2	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金合同生效公告	《证券时报》	2017年1月12日
3	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务公告	《证券时报》	2017年2月11日
4	2016年12月董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	《证券时报》	2017年2月17日
5	浙商基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《证券时报》	2017年2月17日
6	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金开放定期定额投资业务公告	《证券时报》	2017年2月23日
7	浙商基金管理有限公司关于新增万联证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠的公告	《证券时报》	2017年3月7日
8	浙商基金管理有限公司关于旗下部门基金参加平安证券股份有限	《证券时报》	2017年3月8日

	公司定期定额投资业务及其申购基金费率优惠活动的公告		
9	浙商基金管理有限公司关于新增上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	《证券时报》	2017 年 3 月 31 日
10	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	《证券时报》	2017 年 4 月 21 日
11	浙商基金管理有限公司关于新增华泰证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资的公告	《证券时报》	2017 年 5 月 10 日
12	浙商基金管理有限公司关于新增上海通华财富资产管理有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	《证券时报》	2017 年 6 月 12 日
13	浙商基金关于机房改造暂停系统服务的公告	《证券时报》	2017 年 6 月 30 日
14	浙商基金管理有限公司关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告	《证券时报》	2017 年 6 月 30 日

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内不存在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

-
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的相关文件；
- 2、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

浙江省杭州市西湖区教工路 18 号世贸丽晶城欧美中心 B 座 507 室

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.zsfund.com](http://www.zsfund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-067-9908/021-60359000 查询相关信息。

浙商基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日