

浙商沪深300指数分级证券投资基金

【2013】第四季度报告

基金管理人：浙商银行基金管理有限公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司
报告送出日期：2014年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺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责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月17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。

基金管理人承诺，本报告所载的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责任。

基金的投资业绩并不代表其未来表现。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。

本报告自2013年10月1日起生效至2013年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	浙商沪深300指数分级	场内简称	浙商300
基金代码	166802		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年05月17日		
报告期末基金份额总额	106,039,525.76份		

本基金采用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。

本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。力争使跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差率不超过4%。

当期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果造成较大影响时，或因其他特殊情况导致本基金投资组合无法有效复制时，基金管理人可以对该投资组合管理进行适当变通和调整，并予以股指期货等金融衍生品投资策略等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

业绩比较基准

沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%

风险收益特征

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，浙商进取份额具有低风险、收益相对稳定的特征；浙商退取份额具有高风险、高预期收益的特征。

基金管理人 浙商银行基金管理有限公司
基金托管人 华夏银行股份有限公司

下分基金的基本基金简称 浙商稳健 浙商进取 浙商沪深300指数分级(场内简称:浙商300)

下分基金的基本基金代码 150076 150077 82.394.224.76

报告期末下分基金基金份额总额 11,822.650.00份 11,822.651.00份

下分基金的基本基金的风险收益特征

浙商稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征；浙商进取份额具有高风险、高预期收益的特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月01日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,136,943.87
2.本期利润	-3,565,092.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0327
4.期末基金资产净值	93,285,077.44
5.期末基金份额净值	0.8800

§4 基金经理(或基金经理小组)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
关永祥	本基金的基金经理、公司策略发展部副总监、首席金融工程师、投资决策委员会委员	2012年05月07日	10	关永祥先生，北京大学金融学硕士，中科院研究生院软件工程专业硕士、金融学硕士，历任华泰证券股份有限公司、泰阳证券有限责任公司研究员、长信基金管理有限责任公司基金经理、投资决策委员会委员。现任浙商银行基金管理有限公司数量策略研究员。

§5 投资组合报告

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	87,735,170.61	93.39
2	其中：股票	87,735,170.61	93.39
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	6,146,817.31	6.54
10	其他各项资产	59,689.40	0.06
11	合计	93,941,677.32	100.00

§6 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§7 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§8 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§9 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§10 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§11 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§12 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§13 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§14 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§15 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§16 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§17 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§18 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67
C	制造业	32,085,139.91	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,845.98	2.91
E	建筑业	3,009,337.78	3.23
F	批发和零售业	2,814,005.48	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,530.04	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,877.94	2.67
J	金融业	29,575,934.24	31.70
K	房地产业	4,024,306.45	4.31
L	租赁和商务服务业	610,060.13	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,976.86	0.02
O	国民教育、体育和其他服务业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	87,735,170.61	94.05

§19 报告期末(非股权投资)行业分类的股票投资组合

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	639,722.75	0.69
B	采矿业	5,287,662.35	5.67