

浙商沪深300指数分级证券投资基金

[2014] 第二季度报告

基金管理人:浙商基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
报告送出日期:2014年07月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员不保证本基金所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性及完整性负责。

基金管理人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年7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预示其未来表现。投资人投资，须谨慎。

本公司提醒投资者仔细阅读《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》，全面了解本基金的运作特征。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 浙商沪深300指数分级证券投资基金

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末基金份额总额 80,069,798.72份

基金类型 指数型

基金管理人 浙商基金管理有限公司

基金托管人 华夏银行股份有限公司

报告期天数 95天

基金资产净值 100.00元

基金合同生效以来基金份额累计净值增长率 14.4%

最近七日年化收益率 4.35%

风险收益特征 本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资纪律和数量化的风险管理手段，追求与标的指数相同的回报率及适当的跟踪误差。

投资目标 本基金主要采用完全复制法，按照标的指数的构成比例及其权重对股票进行投资，力求保持与标的指数的跟踪误差不超过0.35%，跟踪误差收益率不超过4%。

投资策略 通过定期调整股票组合和现金头寸，以及定期的指数收编和剔除，及时调整股票组合，使投资组合的构成比例符合标的指数的构成比例，从而达到跟踪误差控制在规定的范围之内。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+银行存款利率×5%。

风险收益特征 本基金为指数型基金，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水平高于货币市场基金，从长期看，其收益可能低于股票型基金，但高于债券型基金，其风险收益特征与货币市场基金有本质区别。

基金管理人 浙商基金管理有限公司

基金托管人 华夏银行股份有限公司

报告期末分级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末基金份额总额 2,106,110,000份

基金类型 指数型

基金管理人 浙商基金管理有限公司

基金托管人 华夏银行股份有限公司

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)

基金主代码 166802

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年05月07日

报告期末下级基金的基金简称 浙商稳健

浙商进取

浙商沪深300指数分级基金(场内简称:浙商300)