浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

基金管理人：浙商基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
送出日期：2018年8月28日

§1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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2018年1月1日起至2018年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浙商灵活配置
基金主代码	002076
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月11日
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	50,333,404.42份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过准确把握中国经济周期变动特征，挖掘不同经济周期阶段下优势资产及行业投资机会，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金采用定量分析和定性分析相结合的方法，深入研究我国经济周期当前所处阶段（复苏、扩张、滞胀和衰退）及未来发展方向，确定不同经济周期阶段下的资产配置和行业投资策略，在有效控制风险的前提下，精选优质上市公司股票构建投资组合，力求获得较高的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%＋中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为主动投资的混合型基金，其预期风险和收益高于债券型基金、货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	陆志俊
	联系电话	021-60350812	95559
	电子邮箱	guoleqi@zsfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	95559
传真		0571-28191919	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zsfund.com
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

§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

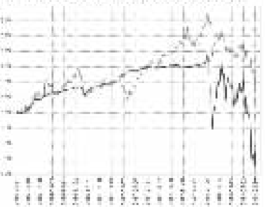
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日－2018年6月30日)
本期已实现收益	-30,111.27
本期利润	-7,589,852.27
加权平均基金份额本期利润	-0.1510
本期加权平均净值利润率	-14.58%
本期基金份额净值增长率	-13.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-3,414,190.56
期末可供分配基金份额利润	-0.0678
期末基金资产净值	46,919,213.86
期末基金份额净值	0.9322

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	-7.62%	1.60%	-3.70%	0.64%	-3.92%	0.96%
过去三个月	-11.96%	1.21%	-4.52%	0.57%	-7.44%	0.64%
过去六个月	-13.93%	1.24%	-5.47%	0.57%	-8.46%	0.67%
过去一年	-13.48%	0.86%	-1.46%	0.47%	-12.02%	0.39%
自基金合同生效起至今	-6.78%	0.60%	6.11%	0.42%	-12.89%	0.18%

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



注：1、本基金基金合同生效日为2016年5月11日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金生效时间已满一年。

2、本基金建仓期为6个月，从2016年5月11日至2016年11月10日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§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2018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、浙商聚盈纯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、浙商全景消费混合型证券投资基金。

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		
周锦程	本基金的基金经理	2017年9月18日	-	7	周锦程先生，复旦大学经济学硕士。历任德邦证券股份有限公司债券交易员、债券研究员、债券投资经理。
查晓磊	本基金的基金经理，公司衍生品及量化投资部总经理	2018年1月12日	-	7	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遵规守信情况的说明

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

从估值及基本面匹配角度看，中证500指数整体处在价值极具吸引力的阶段，因此组合增加了中证500指数成分股的配置，并通过量化模型实现对指数收益的超越。

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0.9322元；本报告期基金份额净值增长率为-13.93%，业绩比较基准收益率为-5.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

融资增速持续向下，导致经济前景不佳，总需求水平大概率下滑，经济下行压力不断加大。具体来看，虽然政策层面对基建给予了补短板的重视，但地方政府财政约束以及房地产领域的严厉管控，才是影响并中长期束缚基建的深层次原因。地产领域虽然销售平稳，新开工和投资增速都观察到了上行，但背后原因并非地产企业正常的周期行为，而是迫于融资压力与悲观前景预期加快资金回笼的结果。因此，到明年地产的压力可能比现在表现出来的要大得多。制造业增速回升，虽然市场很少有人再提朱格拉周期，但制造业却很可能在经历一轮新的产能周期向上，而且伴随着结构的优化和调整，高端制造的偏向和产业升级的趋势蕴藏其中。外贸和消费则可能遭遇短期不利，前者在中美摩擦的进程中充满不确定性，后者或由于房价的挤压效应和收入预期向下而经历一轮短周期向下。

但这一轮短周期向下也无需向上轮四万亿以后那么悲观，最主要的原因是去年的总需求向上并未跟随大规模的产能投放，供需的结构比四万亿之后要更好。因此，本轮的经济具备较强的韧性。

流动性方面，我们基本可以判断政策已往宽松方向转向，从隔夜利率和债券市场的反应看，金融市场的流动性已经可以称之为宽裕，只是大量淤积在金融市场内部打转，金融监管和企业家信心的欠缺，成为流动性向实体经济传导的关键阻梗。从需求周期和居民收入的角度，我们不担心长期通胀，但短期在诸如石油、粮价、猪价、环保等诸多供给端冲击下，到年底的通胀可能反而是需要重点考虑的潜在风险点，一旦通胀起来，将给政策制定又加上一大掣肘。汇率长期取决于两国经济的实体对比，美国和中国很可能在经历两个不同向的周期运行，汇率的压力有可能持续存在。金融监督最为剧烈的时候已经过去，将逐步淡出影响经济流动性的主要因素，而且，从长远看，金融监管的加强化解金融风险实际上有利于奠定经济中长期发展的基础。

从当前估值比较看，A股整体估值水平处于偏低状态，相比于中长期信用债收益率的风险溢价位于80%分位数以上，中长期吸引力已经开始体现。而结构上，以中证500为代表的中盘成长类公司估值更趋历史极端情况。

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

本报告期内本基金存在连续二十个工作日基金持有人数少于200人的情形。

§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

2018年上半年度，基金托管人在浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018年上半年度，浙商基金管理有限公司在浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2018年上半年度，由浙商基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	808,691.18	617,077.25
结算备付金		299,460.28	1,537,097.55
存出保证金		17,410.24	1,091.13
交易性金融资产	6.4.7.2	47,806,868.56	22,932,755.40
其中：股票投资		40,252,251.96	-
基金投资		-	-
债券投资		7,554,616.60	22,932,755.40
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	-	29,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	92,467.56	488,362.88
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		49,024,897.82	54,576,384.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
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		2,000,000.00	-
应付证券清算款		1,315.07	-
应付赎回款		895.77	-
应付管理人报酬		20,019.32	23,065.60
应付托管费		4,003.85	4,613.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,901.98	1,425.18
应交税费		602.56	-
应付利息		-438.35	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	74,383.76	150,000.00
负债合计		2,105,683.96	179,103.90
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	50,333,404.42	50,225,199.27
未分配利润	6.4.7.10	-3,414,190.56	4,172,081.04
所有者权益合计		46,919,213.86	54,397,280.31
负债和所有者权益总计		49,024,897.82	54,576,384.21

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9322元，基金份额总额50333404.42份。

6.2 利润表

会计主体：浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-7,249,110.32	19,946,179.68
1.利息收入		284,779.50	12,828,724.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,630.82	74,792.20
债券利息收入		223,175.58	11,863,010.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		51,973.10	890,922.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		25,643.79	1,031,642.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-237,487.85	11,667,283.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-84,080.50	-10,560,521.45
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	347,212.14	-75,120.26
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	6.4.7.17	-7,559,741.00	6,085,317.48
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	207.39	495.21
减：二、费用		340,741.95	2,568,809.89
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	128,803.77	1,162,526.63
2．托管费	6.4.10.2.2	25,760.74	232,505.28
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	65,117.04	197,723.57
5．利息支出		27,447.52	869,898.44
其中：卖出回购金融资产支出		27,447.52	869,898.44
6．税金及附加		629.12	-
7．其他费用	6.4.7.20	92,983.76	106,155.97
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		-7,589,852.27	17,377,369.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		-7,589,852.27	17,377,369.79

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	50,225,199.27	4,172,081.04	54,397,280.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,589,852.27	-7,589,852.27
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）	108,205.15	3,580.67	111,785.82
其中：1.基金申购款	174,202.16	5,996.81	180,198.97
2.基金赎回款	-65,997.01	-2,416.14	-68,413.15
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）	50,333,404.42	-3,414,190.56	46,919,213.86

项目	上年度可比期间 2017年1月1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）	772,770,183.88	28,792,717.60	801,562,901.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,377,369.79	17,377,369.79
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）	-722,461,058.51	-42,269,659.59	-764,730,718.10
其中：1.基金申购款	139,744.64	8,963.14	148,707.78
2.基金赎回款	-722,600,803.15	-42,278,622.73	-764,879,425.88
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）	50,309,125.37	3,900,427.80	54,209,553.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

聂挺进 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

浙商聚潮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")《关于准予浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可 [2015]1578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《浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年5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，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")。

本基金于2016年4月26日至2016年5月6日募集，募集期间净认购资金人民币200,602,493.96元，认购资金在募集期间产生的利息人民币57.09元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计200,602,551.05份。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1600303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、《浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《浙商聚潮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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券（包含中小企业私募债券）、中期票据、股指期货、权证、资产支持证券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。本基金投资于股票资产占基金资产的比例范围为0% － 95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种以及其他资产占基金资产的比例范围为5% － 100%，其中基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5% 。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%＋中债综合指数收益率×50% 。

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及附注2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况、2018年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税 [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 [2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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)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。

(b)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。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在2018年1月1日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

(c)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。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司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。

(e)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。

(f)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，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

注：本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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
交通银行股份有限公司	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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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交易。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本期间没有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	128,803.77	1,162,526.63
其中：支付销售机构的客户维护费	608.55	852.20

注：支付基金管理人浙商基金管理有限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×1.0%/当年天数（自2016年5月11日（基金合同生效日）至2016年7月21日）

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.5%/当年天数（自2016年7月22日起）

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,760.74	232,505.28

注：支付基金托管人交通银行的基金托管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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数（自2016年5月11日（基金合同生效日）至2016年7月21日）

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数（自2016年7月22日起）

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未持有过本基金。

6.4.8.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
交通银行股份有限公司	808,691.18	7,189.52	560,613.53	39,038.05

注：本基金通过"交通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 2018年6月30日的相关余额为人民币299,460.28元。(2017年6月30日：人民币 0元)

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（ 2018年6月30日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

于2018年6月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

6.4.9.2 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	备注
000825	太钢不锈	2018年4月16日	临时停牌	6.00	-	-	37,000	193,733.71	222,000.00	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	临时停牌	2.02	2018年8月16日	1.83	71,300	155,328.95	144,026.00	-
300146	汤臣倍健	2018年1月31日	临时停牌	15.35	2018年7月31日	16.50	9,100	146,508.00	139,685.00	-
002408	齐翔腾达	2018年6月19日	临时停牌	12.28	-	-	10,600	134,635.57	130,168.00	-
600848	上海临港	2018年6月15日	临时停牌	21.67	-	-	6,000	149,324.40	130,020.00	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	临时停牌	19.58	2018年8月21日	17.62	6,600	149,211.68	129,228.00	-
300266	兴源环境	2018年2月5日	临时停牌	19.99	2018年7月2日	17.99	6,400	158,101.00	127,936.00	-
002051	中工国际	2018年4月9日	临时停牌	15.27	-	-	7,200	131,209.48	109,944.00	-
002699	美盛文化	2018年2月5日	临时停牌	18.76	2018年7月2日	16.88	5,600	97,317.00	105,056.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	临时停牌	9.49	-	-	10,688	108,683.87	101,429.12	-
600811	东方集团	2018年5月30日	临时停牌	4.30	-	-	22,500	106,449.19	96,750.00	-
002665	首航节能	2018年5月29日	临时停牌	5.80	-	-	15,400	98,177.03	89,320.00	-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	临时停牌	6.20	2018年8月13日	5.57	13,600	91,729.00	84,320.00	-
600687	刚泰控股	2018年6月11日	临时停牌	9.09	2018年8月20日	8.18	9,000	104,282.03	81,810.00	-
000426	兴业矿业	2018年6月19日	临时停牌	7.21	2018年8月27日	6.47	11,100	109,731.97	80,031.00	-
002573	清新环境	2018年6月19日	临时停牌	11.55	-	-	6,500	127,922.76	75,075.00	-
300197	铁汉生态	2018年5月28日	临时停牌	5.37	-	-	13,800	101,569.10	74,106.00	-
600335	国机汽车	2018年4月3日	临时停牌	10.43	-	-	6,700	69,899.85	69,881.00	-
600158	中体产业	2018年3月27日	临时停牌	11.64	2018年7月16日	11.61	5,501	59,386.38	64,031.64	-
002512	达华智能	2018年6月19日	临时停牌	9.70	-	-	6,600	82,928.53	64,020.00	-
000587	金洲慈航	2018年6月15日	临时停牌	4.96	2018年7月2日	4.46	12,900	92,928.86	63,984.00	-
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	临时停牌	3.31	-	-	18,900	84,062.97	62,559.00	-
002431	棕榈股份	2018年5月30日	临时停牌	6.71	-	-	9,000	76,494.16	60,390.00	-
600759	洲际油气	2018年3月27日	临时停牌	3.94	-	-	14,800	65,351.24	58,312.00	-
600122	宏图高科	2018年6月19日	临时停牌	7.40	-	-	6,900	66,064.78	51,060.00	-
600750	江中药业	2018年5月2日	临时停牌	17.75	2018年8月1日	16.12	2,660	50,589.00	47,215.00	-
002147	新光圆成	2018年1月18日	临时停牌	14.76	-	-	2,600	37,642.00	38,376.00	-
002011	盾安环境	2018年5月2日	临时停牌	6.40	-	-	5,900	46,787.00	37,760.00	-
000669	金鸿控股	2018年5月18日	临时停牌	7.25	2018年8月6日	6.53	4,131	39,832.59	29,949.75	-
600086	东方金钰	2018年1月19日	临时停牌	10.04	-	-	2,700	28,749.00	27,108.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于2018年6月30日，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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,000,000.00元，于2018年7月2日到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 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。

§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	40,252,251.96	82.11
	其中：股票	40,252,251.96	82.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,554,616.60	15.41
	其中：债券	7,554,616.60	15.41
	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	1,108,151.46	2.26
8	其他各项资产	109,877.80	0.22
9	合计	49,024,897.82	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	587,631.00	1.25
B	采矿业	1,307,873.64	2.79
C	制造业	24,369,568.93	51.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,230,543.75	2.62
E	建筑业	735,786.00	1.57
F	批发和零售业	2,260,190.20	4.82
G	交通运输、仓储和邮政业	1,481,966.76	3.16
H	住宿和餐饮业	177,444.96	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,019,924.92	6.44
J	金融业	795,000.06	1.69
K	房地产业	2,187,249.44	4.66
L	租赁和商务服务业	733,073.30	1.56
M	科学研究和技术服务业	46,224.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	400,816.00	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	50,414.00	0.11
Q	卫生和社会工作	64,634.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	695,661.00	1.48
S	综合	108,250.00	0.23
	合计	40,252,251.96	85.79

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	600346	恒力股份	29,800	436,868.00	0.93
2	002422	科伦药业	8,500	272,850.00	0.58
3	002563	森马服饰	18,400	263,120.00	0.56
4	600516	方大炭素	10,700	260,866.00	0.56
5	002032	苏 泊 尔	4,900	252,350.00	0.54
6	000661	长春高新	1,100	250,470.00	0.53
7	002001	新 和 成	12,890	244,394.40	0.52
8	603899	晨光文具	7,700	244,013.00	0.52
9	002050	三花智控	12,500	235,625.00	0.50
10	600566	济川药业	4,800	231,312.00	0.49
11	603589	口子窖	3,700	227,365.00	0.48
12	000825	太钢不锈	37,000	222,000.00	0.47
13	300308	中际旭创	3,600	216,144.00	0.46
14	603658	安图生物	2,600	214,396.00	0.46
15	000596	古井贡酒	2,400	213,072.00	0.45
16	603885	吉祥航空	13,800	212,658.00	0.45
17	600176	中国巨石	20,740	212,170.20	0.45
18	000703	恒逸石化	13,800	205,344.00	0.44
19	600521	华海药业	7,460	199,107.40	0.42
20	002311	海大集团	9,400	198,340.00	0.42
21	000786	北新建材	10,600	196,418.00	0.42
22	603816	顾家家居	2,600	191,126.00	0.41
23	000418	小天鹅A	2,700	187,245.00	0.40
24	601233	桐昆股份	10,860	187,009.20	0.40
25	000977	浪潮信息	7,801	186,053.85	0.40
26	002410	广联达	6,700	185,791.00	0.40
27	002179	中航光电	4,700	183,300.00	0.39
28	600600	青岛啤酒	4,100	179,703.00	0.38
29	603019	中科曙光	3,900	178,893.00	0.38
30	600754	锦江股份	4,801	177,444.96	0.38
31	000981	银亿股份	23,700	176,565.00	0.38
32	600298	安琪酵母	4,901	174,867.68	0.37
33	000050	深天马A	12,100	172,062.00	0.37
34	603369	今世缘	7,500	171,225.00	0.36
35	600426	华鲁恒升	9,600	168,864.00	0.36
36	000999	华润三九	5,900	164,197.00	0.35
37	603515	欧普照明	3,500	163,590.00	0.35
38	002049	紫光国微	3,700	163,244.00	0.35
39	600256	广汇能源	39,610	162,004.90	0.35
40	002013	中航机电	21,300	161,241.00	0.34
41	600004	白云机场	12,200	159,698.00	0.34
42	600438	通威股份	23,000	158,700.00	0.34
43	600315	上海家化	4,000	158,520.00	0.34
44	002405	四维图新	7,700	155,925.00	0.33
45	002038	双鹭药业	4,100	155,759.00	0.33
46	002271	东方雨虹	9,011	153,277.11	0.33
47	600673	东阳光科	14,700	151,851.00	0.32
48	000656	金科股份	31,600	151,680.00	0.32
49	002506	协鑫集成	32,200	150,696.00	0.32
50	600884	杉杉股份	6,800	150,280.00	0.32
51	603883	老百姓	1,800	149,688.00	0.32
52	000830	鲁西化工	8,700	148,596.00	0.32
53	002078	太阳纸业	15,300	148,257.00	0.32
54	000732	泰禾集团	7,500	145,875.00	0.31
55	600022	山东钢铁	71,300	144,026.00	0.31
56	000998	隆平高科	7,500	141,450.00	0.30
57	300146	汤臣倍健	9,100	139,685.00	0.30
58	002371	北方华创	2,800	139,076.00	0.30
59	002640	跨境通	9,200	138,184.00	0.29
60	002340	格林美	22,600	136,730.00	0.29
61	002127	南极电商	14,550	136,624.50	0.29
62	600584	长电科技	8,000	135,520.00	0.29
63	600885	宏发股份	4,520	135,238.40	0.29
64	600642	申能股份	26,900	135,038.00	0.29
65	002384	东山精密	5,600	134,400.00	0.29
65	600872	中炬高新	4,800	134,400.00	0.29
66	600392	盛和资源	8,100	131,463.00	0.28
67	000860	顺鑫农业	3,500	131,250.00	0.28
68	603868	飞科电器	2,700	130,599.00	0.28
69	002408	齐翔腾达	10,600	130,168.00	0.28
70	600848	上海临港	6,000	130,020.00	0.28
71	002359	北讯集团	6,600	129,228.00	0.28
72	300266	兴源环境	6,400	127,936.00	0.27
73	600062	华润双鹤	5,200	127,660.00	0.27
74	600967	内蒙一机	10,000	127,400.00	0.27
75	002019	亿帆医药	7,200	127,080.00	0.27
76	600808	马钢股份	35,300	126,727.00	0.27
77	000513	丽珠集团	2,860	125,697.00	0.27
78	002670	国盛金控	11,578	124,695.06	0.27
79	600578	京能电力	39,900	124,488.00	0.27
80	600511	国药股份	4,600	123,970.00	0.26
81	000066	中国长城	17,400	123,714.00	0.26
82	603228	景旺电子	2,500	123,600.00	0.26
83	300253	卫宁健康	9,800	121,422.00	0.26
84	002589	瑞康医药	8,900	121,396.00	0.26
85	000681	视觉中国	4,200	120,540.00	0.26
86	000975	银泰资源	11,840	120,057.60	0.26
87	600201	生物股份	7,020	119,971.80	0.26
88	000960	锡业股份	9,900	118,899.00	0.25
89	002223	鱼跃医疗	6,100	118,889.00	0.25
90	600160	巨化股份	16,240	118,876.80	0.25
91	601231	环旭电子	12,900	117,003.00	0.25
92	600056	中国医药	6,401	116,946.27	0.25
93	300182	捷成股份	15,400	116,732.00	0.25
94	002439	启明星辰	5,500	116,710.00	0.25
95	000027	深圳能源	23,600	116,584.00	0.25
96	600282	南钢股份	26,200	115,804.00	0.25
97	600183	生益科技	12,605	115,461.80	0.25
98	300383	光环新网	8,600	115,326.00	0.25
99	000028	国药一致	2,300	114,770.00	0.24
100	002299	圣农发展	7,400	114,626.00	0.24
101	002373	千方科技	8,700	113,535.00	0.24
102	600572	康恩贝	15,800	113,286.00	0.24
103	600270	外运发展	5,401	113,204.96	0.24
104	600879	航天电子	16,100	113,183.00	0.24
105	600260	凯乐科技	4,200	112,728.00	0.24
106	000729	燕京啤酒	16,700	112,391.00	0.24
107	002745	木林森	6,300	112,077.00	0.24
108	002195	二三四五	26,130	111,836.40	0.24
109	300133	华策影视	10,500	111,825.00	0.24
110	600623	华谊集团	11,200	111,776.00	0.24
111	000581	威孚高科	5,000	110,550.00	0.24
112	600380	健康元	9,300	110,298.00	0.24
113	002051	中工国际	7,200	109,944.00	0.23
114	600466	蓝光发展	17,660	109,492.00	0.23
115	002268	卫 士 通	5,000	109,150.00	0.23
116	000887	中鼎股份	7,400	106,634.00	0.23
117	600079	人福医药	8,000	105,760.00	0.23
118	002699	美盛文化	5,600	105,056.00	0.22
119	600409	三友化工	12,200	105,042.00	0.22
120	000990	诚志股份	7,500	105,000.00	0.22
121	600060	海信电器	7,800	104,442.00	0.22
122	600098	广州发展	16,100	103,845.00	0.22
123	000987	越秀金控	13,200	103,752.00	0.22
124	603568	伟明环保	4,100	103,730.00	0.22
125	600648	外高桥	5,600	102,368.00	0.22
126	600348	阳泉煤业	14,300	102,245.00	0.22
127	000778	新兴铸管	23,700	101,436.00	0.22
128	300324	旋极信息	10,688	101,429.12	0.22
129	000039	中集集团	7,600	100,928.00	0.22
130	002603	以岭药业	7,200	100,656.00	0.21
131	600161	天坛生物	5,200	100,620.00	0.21
131	600787	中储股份	13,000	100,620.00	0.21
132	600598	北大荒	10,700	98,012.00	0.21
133	600718	东软集团	7,500	97,950.00	0.21
134	600859	王府井	4,600	97,842.00	0.21
135	600811	东方集团	22,500	96,750.00	0.21
136	603877	太平鸟	2,900	96,657.00	0.21
137	600325	华发股份	12,500	96,625.00	0.21
138	600460	士兰微	7,900	96,380.00	0.21
139	000997	新 大 陆	6,100	96,075.00	0.20
140	002221	东华能源	9,800	95,746.00	0.20
141	002244	滨江集团	18,400	95,680.00	0.20
142	002690	美亚光电	4,000	95,360.00	0.20
143	601127	小康股份	5,400	93,366.00	0.20
144	300166	东方国信	6,300	92,799.00	0.20
145	600823	世茂股份	22,200	92,796.00	0.20
146	002353	杰瑞股份	5,700	92,625.00	0.20
147	000089	深圳机场	12,100	92,565.00	0.20
148	600126	杭钢股份	15,500	92,535.00	0.20
149	002517	恺英网络	12,750	91,672.50	0.20
150	600737	中粮糖业	12,100	91,234.00	0.19
151	601928	凤凰传媒	15,000	91,200.00	0.19
152	600835	上海机电	4,800	90,528.00	0.19
153	000690	宝新能源	13,000	90,480.00	0.19
154	603077	和邦生物	52,200	90,306.00	0.19
155	600643	爱建集团	9,600	90,240.00	0.19
156	002583	海能达	10,800	90,180.00	0.19
157	002183	怡 亚 通	13,500	89,775.00	0.19
158	600179	安通控股	8,860	89,751.80	0.19
159	600545	卓郎智能	11,300	89,722.00	0.19
160	600582	天地科技	24,400	89,548.00	0.19
161	002665	首航节能	15,400	89,320.00	0.19
162	601168	西部矿业	14,200	89,176.00	0.19
163	601880	大连港	45,500	88,270.00	0.19
164	603198	迎驾贡酒	4,800	88,176.00	0.19
165	002128	露天煤业	9,700	87,882.00	0.19
166	600266	北京城建	9,300	87,420.00	0.19
167	600801	华新水泥	5,800	87,174.00	0.19
168	600291	西水股份	6,500	86,840.00	0.19
169	000988	华工科技	6,000	86,700.00	0.18
170	600875	东方电气	11,700	86,697.00	0.18
171	000488	晨鸣纸业	6,700	86,564.00	0.18
172	600317	营口港	38,300	86,558.00	0.18
173	600138	中青旅	4,300	85,699.00	0.18
174	600037	歌华有线	8,300	85,656.00	0.18
175	002176	江特电机	8,800	85,536.00	0.18
176	000937	冀中能源	20,800	85,488.00	0.18
177	600575	皖江物流	22,900	84,959.00	0.18
178	002152	广电运通	14,400	84,672.00	0.18
179	002437	誉衡药业	13,600	84,320.00	0.18
180	000062	深圳华强	4,300	84,280.00	0.18
181	000636	风华高科	5,300	84,164.00	0.18
182	002491	通鼎互联	7,600	84,132.00	0.18
183	600500	中化国际	12,300	83,886.00	0.18
184	601689	拓普集团	4,300	83,592.00	0.18
185	600143	金发科技	16,000	83,520.00	0.18
186	600525	长园集团	7,900	83,503.00	0.18
187	600277	亿利洁能	15,900	83,316.00	0.18
188	000761	本钢板材	20,600	83,224.00	0.18
189	600338	西藏珠峰	4,000	82,880.00	0.18
190	002358	森源电气	5,500	82,775.00	0.18
191	002281	光迅科技	3,900	82,680.00	0.18
192	600729	重庆百货	2,500	82,375.00	0.18
193	601000	唐山港	34,820	81,827.00	0.17
194	600687	刚泰控股	9,000	81,810.00	0.17
195	600388	龙净环保	6,400	81,792.00	0.17
196	002242	九阳股份	4,600	81,374.00	0.17
197	002233	塔牌集团	7,101	81,235.44	0.17
198	000807	云铝股份	15,600	80,808.00	0.17
199	002440	闰土股份	6,900	80,661.00	0.17
200	600655	豫园股份	8,500	80,325.00	0.17
201	000878	云南铜业	8,400	80,136.00	0.17
202	000426	兴业矿业	11,100	80,031.00	0.17
203	300199	翰宇药业	5,600	79,968.00	0.17
204	600166	福田汽车	39,200	79,576.00	0.17
205	002815	崇达技术	4,900	78,890.00	0.17
206	300088	长信科技	13,600	78,880.00	0.17
207	600755	厦门国贸	10,800	78,732.00	0.17
208	300257	开山股份	5,100	77,979.00	0.17
209	600839	四川长虹	27,200	77,792.00	0.17
210	600094	大名城	13,500	77,760.00	0.17
211	002002	鸿达兴业	16,800	77,448.00	0.17
212	600863	内蒙华电	34,100	77,407.00	0.16
213	002635	安洁科技	4,500	77,400.00	0.16
214	600307	酒钢宏兴	36,800	77,280.00	0.16
215	300274	阳光电源	8,600	77,142.00	0.16
216	002701	奥瑞金	14,000	76,440.00	0.16
217	002681	奋达科技	8,800	76,208.00	0.16
218	603025	大豪科技	3,920	75,812.80	0.16
219	002368	太极股份	2,600	75,582.00	0.16
220	002028	思源电气	4,500	75,555.00	0.16
221	601128	常熟银行	13,200	75,504.00	0.16
222	002285	世联行	12,000	75,240.00	0.16
223	002573	清新环境	6,500	75,075.00	0.16
224	000078	海王生物	15,600	75,036.00	0.16
225	600717	天津港	9,900	74,547.00	0.16
226	002366	台海核电	5,200	74,152.00	0.16
227	300197	铁汉生态	13,800	74,106.00	0.16
228	600216	浙江医药	5,800	74,066.00	0.16
229	600155	宝硕股份	10,300	74,057.00	0.16
230	002390	信邦制药	10,100	73,932.00	0.16
231	002280	联络互动	12,900	73,788.00	0.16
232	600418	江淮汽车	11,300	73,563.00	0.16
233	300058	蓝色光标	12,900	73,530.00	0.16
234	300113	顺网科技	4,200	73,122.00	0.16
235	002030	达安基因	4,730	72,936.60	0.16
236	603355	莱克电气	2,400	72,120.00	0.15
237	600597	光明乳业	7,300	72,051.00	0.15
238	600435	北方导航	8,800	71,808.00	0.15
239	000528	柳　工	6,700	71,757.00	0.15
240	600881	亚泰集团	19,200	71,616.00	0.15
241	002444	巨星科技	6,500	71,565.00	0.15
242	603806	福斯特	3,250	71,532.50	0.15
243	000598	兴蓉环境	17,600	71,456.00	0.15
244	002818	富森美	2,700	71,226.00	0.15
245	000401	冀东水泥	8,000	70,960.00	0.15
246	600120	浙江东方	5,200	70,460.00	0.15
247	002434	万里扬	8,000	70,240.00	0.15
248	600039	四川路桥	21,400	70,192.00	0.15
249	600970	中材国际	10,500	70,140.00	0.15
250	000685	中山公用	8,800	70,136.00	0.15
251	300115	长盈精密	5,400	70,038.00	0.15
252	601016	节能风电	24,400	70,028.00	0.15
253	600335	国机汽车	6,700	69,881.00	0.15
254	002505	大康农业	32,400	69,336.00	0.15
255	600563	法拉电子	1,400	69,286.00	0.15
256	002131	利欧股份	32,900	69,090.00	0.15
257	002056	横店东磁	9,800	68,698.00	0.15
258	600026	中远海能	16,200	68,688.00	0.15
259	300001	特锐德	6,000	68,160.00	0.15
260	603766	隆鑫通用	12,500	67,875.00	0.14
261	002273	水晶光电	5,230	67,310.10	0.14
262	600329	中新药业	3,500	66,500.00	0.14
263	601200	上海环境	4,200	66,486.00	0.14
264	002191	劲嘉股份	8,900	66,483.00	0.14
265	000547	航天发展	8,500	66,385.00	0.14
266	000718	苏宁环球	17,900	65,693.00	0.14
267	300026	红日药业	17,900	65,335.00	0.14
268	600125	铁龙物流	7,800	65,286.00	0.14
269	002503	搜于特	18,600	65,100.00	0.14
270	600536	中国软件	3,000	64,890.00	0.14
271	600908	无锡银行	11,000	64,790.00	0.14
272	300244	迪安诊断	3,400	64,634.00	0.14
273	600499	科达洁能	9,400	64,484.00	0.14
274	600158	中体产业	5,501	64,031.64	0.14
275	002512	达华智能	6,600	64,020.00	0.14
276	000587	金洲慈航	12,900	63,984.00	0.14
277	300010	立思辰	5,200	63,648.00	0.14
277	600639	浦东金桥	5,100	63,648.00	0.14
278	601969	海南矿业	11,600	63,568.00	0.14
279	000031	中粮地产	10,900	63,002.00	0.13
280	600917	重庆燃气	9,200	62,652.00	0.13
281	002477	雏鹰农牧	18,900	62,559.00	0.13
282	300159	新研股份	9,600	62,304.00	0.13
283	000009	中国宝安	12,700	62,230.00	0.13
284	000563	陕国投A	18,300	62,220.00	0.13
285	600869	智慧能源	13,100	61,832.00	0.13
286	600240	华业资本	8,400	61,572.00	0.13
287	002004	华邦健康	12,100	61,468.00	0.13
288	300287	飞利信	8,500	61,115.00	0.13
289	002249	大洋电机	14,100	60,771.00	0.13
290	600874	创业环保	6,500	60,710.00	0.13
291	002431	棕榈股份	9,000	60,390.00	0.13
292	600280	中央商场	6,900	60,168.00	0.13
293	600978	宜华生活	8,800	60,104.00	0.13
294	600664	哈药股份	15,100	59,947.00	0.13
295	000970	中科三环	6,400	59,840.00	0.13
296	300055	万邦达	5,200	59,748.00	0.13
297	600395	盘江股份	9,800	59,486.00	0.13
298	000021	深科技	8,700	59,334.00	0.13
299	002251	步 步 高	5,200	59,176.00	0.13
300	000600	建投能源	10,600	59,042.00	0.13
301	002807	江阴银行	10,500	59,010.00	0.13
302	600580	卧龙电气	7,700	58,674.00	0.13
303	600694	大商股份	1,800	58,518.00	0.12
304	601311	骆驼股份	5,100	58,497.00	0.12
305	600759	洲际油气	14,800	58,312.00	0.12
306	600017	日照港	18,100	58,101.00	0.12
307	600410	华胜天成	6,600	57,750.00	0.12
308	601678	滨化股份	9,210	56,917.80	0.12
309	300297	蓝盾股份	7,000	56,770.00	0.12
310	000501	鄂武商A	4,600	56,534.00	0.12
311	600393	粤泰股份	15,500	56,110.00	0.12
312	600259	广晟有色	1,900	55,632.00	0.12
313	002118	紫鑫药业	7,700	55,055.00	0.12
314	600748	上实发展	10,900	54,936.00	0.12
315	603000	人民网	6,600	54,780.00	0.12
316	000025	特 力A	1,700	54,689.00	0.12
317	002407	多氟多	3,900	54,678.00	0.12
318	000061	农 产 品	10,100	54,540.00	0.12
319	600064	南京高科	7,420	54,462.80	0.12
320	603556	海兴电力	2,990	54,328.30	0.12
321	002482	广田集团	9,100	54,327.00	0.12
322	000012	南 玻A	10,925	54,078.75	0.12
323	603888	新华网	3,200	53,952.00	0.11
324	000712	锦龙股份	5,400	53,892.00	0.11
325	002672	东江环保	4,101	53,682.09	0.11
326	000090	天健集团	8,640	53,568.00	0.11
327	600939	重庆建工	10,800	53,352.00	0.11
328	600635	大众公用	14,300	53,196.00	0.11
329	600058	五矿发展	6,400	53,184.00	0.11
330	002707	众信旅游	5,403	51,868.80	0.11
331	002354	天神娱乐	5,600	51,856.00	0.11
332	002317	众生药业	4,900	51,793.00	0.11
333	600614	鹏起科技	9,000	51,390.00	0.11
334	601717	郑煤机	8,800	51,128.00	0.11
335	603444	吉比特	400	51,116.00	0.11
336	002414	高德红外	3,800	51,072.00	0.11
337	600122	宏图高科	6,900	51,060.00	0.11
338	600195	中牧股份	2,600	50,570.00	0.11
339	600141	兴发集团	4,340	50,561.00	0.11
340	600862	中航高科	8,200	50,430.00	0.11
341	603377	东方时尚	3,640	50,414.00	0.11
342	000979	中弘股份	49,800	50,298.00	0.11
343	000727	华东科技	26,700	50,196.00	0.11
344	603569	长久物流	3,500	49,980.00	0.11
345	300002	神州泰岳	11,900	49,623.00	0.11
346	601001	大同煤业	10,000	49,600.00	0.11
347	002155	湖南黄金	7,200	49,248.00	0.10
348	600640	号百控股	4,800	48,816.00	0.10
349	600171	上海贝岭	4,200	48,636.00	0.10
350	002250	联化科技	5,500	48,510.00	0.10
351	600006	东风汽车	11,800	48,262.00	0.10
352	002332	仙琚制药	5,500	48,125.00	0.10
353	002544	杰赛科技	3,500	47,915.00	0.10
354	600750	江中药业	2,660	47,215.00	0.10
355	000543	皖能电力	10,700	47,187.00	0.10
356	600936	广西广电	9,900	47,124.00	0.10
357	002489	浙江永强	12,900	46,956.00	0.10
358	600557	康缘药业	3,800	46,930.00	0.10
359	000006	深振业A	8,000	46,880.00	0.10
360	000400	许继电气	6,000	46,860.00	0.10
361	002048	宁波华翔	3,800	46,854.00	0.10
362	002345	潮宏基	5,400	46,440.00	0.10
363	600053	九鼎投资	2,700	46,359.00	0.10
364	002093	国脉科技	6,000	46,260.00	0.10
365	600645	中源协和	2,400	46,224.00	0.10
366	000829	天音控股	6,300	46,179.00	0.10
367	600770	综艺股份	7,800	46,020.00	0.10
368	600996	贵广网络	6,200	46,004.00	0.10
369	600993	马应龙	2,700	45,927.00	0.10
370	600312	平高电气	8,100	45,684.00	0.10
370	601811	新华文轩	4,700	45,684.00	0.10
371	002308	威创股份	5,500	45,650.00	0.10
372	002123	梦网集团	5,100	45,339.00	0.10
373	000536	华映科技	16,400	45,100.00	0.10
374	600428	中远海特	12,700	45,085.00	0.10
375	600478	科力远	8,800	44,880.00	0.10
376	000552	靖远煤电	13,600	44,472.00	0.09
377	601020	华钰矿业	3,200	44,128.00	0.09
378	002266	浙富控股	11,700	43,875.00	0.09
379	002416	爱施德	7,460	43,790.20	0.09
380	002269	美邦服饰	14,900	43,210.00	0.09
381	600971	恒源煤电	6,001	42,847.14	0.09
382	600662	天夏智慧	6,630	42,630.90	0.09
383	000877	天山股份	6,300	42,525.00	0.09
384	002375	亚厦股份	7,900	42,186.00	0.09
385	600565	迪马股份	14,300	42,185.00	0.09
386	600594	益佰制药	4,700	42,112.00	0.09
387	002254	泰和新材	3,700	42,106.00	0.09
388	300134	大富科技	4,700	42,018.00	0.09
389	000926	福星股份	5,800	41,702.00	0.09
390	600757	长江传媒	7,300	41,537.00	0.09
391	600416	湘电股份	5,700	40,983.00	0.09
392	002064	华峰氨纶	9,900	40,887.00	0.09
393	600316	洪都航空	4,300	40,076.00	0.09
394	600059	古越龙山	4,800	39,120.00	0.08
395	000969	安泰科技	6,200	38,750.00	0.08
396	002277	友阿股份	8,400	38,724.00	0.08
397	600184	光电股份	3,100	38,409.00	0.08
398	002147	新光圆成	2,600	38,376.00	0.08
399	600618	氯碱化工	4,500	38,295.00	0.08
400	000541	佛山照明	6,390	38,276.10	0.08
401	600657	信达地产	9,000	38,250.00	0.08
402	002011	盾安环境	5,900	37,760.00	0.08
403	603188	亚邦股份	3,700	37,740.00	0.08
404	002642	荣之联	4,100	37,679.00	0.08
405	002190	成飞集成	2,200	37,598.00	0.08
406	002344	海宁皮城	7,700	37,422.00	0.08
407	002463	沪电股份	10,001	37,403.74	0.08
408	000612	焦作万方	7,100	37,275.00	0.08
409	600073	上海梅林	5,600	37,184.00	0.08
410	600503	华丽家族	9,500	37,145.00	0.08
411	300039	上海凯宝	6,400	37,120.00	0.08
412	002022	科华生物	3,100	36,735.00	0.08
413	600366	宁波韵升	6,020	36,722.00	0.08
414	000049	德赛电池	1,300	36,686.00	0.08
415	600611	大众交通	9,200	36,616.00	0.08
416	600422	昆药集团	4,700	36,425.00	0.08
417	002276	万马股份	6,200	36,208.00	0.08
418	002588	史丹利	6,900	35,742.00	0.08
419	600169	太原重工	15,200	35,568.00	0.08
420	600743	华远地产	13,800	35,466.00	0.08
421	002041	登海种业	5,200	35,464.00	0.08
422	300202	聚龙股份	3,400	35,462.00	0.08
423	600458	时代新材	4,800	35,328.00	0.08
424	600826	兰生股份	2,600	35,282.00	0.08
425	600765	中航重机	4,700	34,968.00	0.07
426	300291	华录百纳	4,900	34,545.00	0.07
427	600151	航天机电	8,500	34,510.00	0.07
428	600587	新华医疗	2,500	34,075.00	0.07
429	600773	西藏城投	4,900	33,908.00	0.07
430	000572	海马汽车	9,800	33,614.00	0.07
431	002400	省广集团	10,400	33,592.00	0.07
432	600108	亚盛集团	11,600	33,524.00	0.07
433	001696	宗申动力	6,800	33,320.00	0.07
434	002657	中科金财	2,100	33,264.00	0.07
435	000592	平潭发展	11,500	32,660.00	0.07
436	300273	和佳股份	4,800	32,544.00	0.07
437	000667	美好置业	15,200	32,376.00	0.07
438	600300	维维股份	9,900	32,274.00	0.07
439	002073	软控股份	5,600	32,200.00	0.07
440	002663	普邦股份	10,700	31,779.00	0.07
441	603169	兰石重装	6,300	31,563.00	0.07
442	002063	远光软件	3,700	31,302.00	0.07
443	002428	云南锗业	4,000	30,880.00	0.07
444	002261	拓维信息	6,700	30,820.00	0.07
445	000762	西藏矿业	3,200	30,816.00	0.07
446	600894	广日股份	5,100	30,243.00	0.06
447	603528	多伦科技	3,800	30,172.00	0.06
448	300043	星辉娱乐	7,500	30,000.00	0.06
449	000669	金鸿控股	4,131	29,949.75	0.06
450	002479	富春环保	5,300	29,945.00	0.06
451	603001	奥康国际	2,500	29,775.00	0.06
452	600517	置信电气	8,000	29,600.00	0.06
453	600481	双良节能	9,600	29,376.00	0.06
454	300147	香雪制药	4,000	28,840.00	0.06
455	601002	晋亿实业	4,700	28,717.00	0.06
456	000806	银河生物	6,600	28,578.00	0.06
457	600880	博瑞传播	6,700	28,542.00	0.06
458	600187	国中水务	10,000	28,400.00	0.06
459	600284	浦东建设	5,800	28,304.00	0.06
460	600628	新世界	3,900	28,002.00	0.06
461	002325	洪涛股份	7,500	27,750.00	0.06
462	600292	远达环保	4,700	27,589.00	0.06
463	600776	东方通信	5,700	27,588.00	0.06
464	600652	泰达股份	8,700	27,144.00	0.06
465	600086	东方金钰	2,700	27,108.00	0.06
466	002551	尚荣医疗	4,200	25,830.00	0.06
467	600680	山推股份	7,400	25,456.00	0.05
468	002106	莱宝高科	4,200	24,192.00	0.05
469	002392	北京利尔	7,100	24,140.00	0.05
470	000099	中信海直	3,700	23,532.00	0.05
471	000651	飞乐音响	5,900	23,010.00	0.05
472	000777	中核科技	2,400	22,416.00	0.05
473	000897	津滨发展	9,600	21,696.00	0.05
474	002342	巨力索具	5,700	21,603.00	0.05
475	002018	*ST华信	13,800	20,010.00	0.04
476	603225	新凤鸣	840	16,774.80	0.04
477	000816	*ST慧业	8,400	13,440.00	0.03

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	600346	恒力股份	484,818.00	0.89
2	600516	方大炭素	371,152.00	0.68
3	002001	新 和 成	369,059.00	0.68
4	600176	中国巨石	345,063.00	0.63
5	600438	通威股份	316,319.00	0.58
6	000732	泰禾集团	314,636.00	0.58
7	000786	北新建材	285,648.00	0.53
8	002050	三花智控	281,286.00	0.52
9	002422	科伦药业	259,391.00	0.48
10	002563	森马服饰	245,408.00	0.45
11	603885	吉祥航空	244,781.00	0.45
12	300308	中际旭创	244,531.00	0.45
13	000050	深天马A	243,906.00	0.45
14	603899	晨光文具	243,808.00	0.45
15	002311	海大集团	243,348.00	0.45
16	000703	恒逸石化	236,133.00	0.43
17	002271	东方雨虹	235,455.00	0.43
18	000981	银亿股份	231,524.00	0.43
19	002032	苏 泊 尔	230,956.00	0.42
20	600566	济川药业	228,190.00	0.42

7.4.2 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	600438	通威股份	51,725.00	0.10
2	600176	中国巨石	46,957.00	0.09
3	002422	科伦药业	45,717.00	0.08
4	002001	新 和 成	44,037.00	0.08
5	600516	方大炭素	43,686.00	0.08
6	002311	海大集团	37,965.00	0.07
7	002050	三花智控	36,886.00	0.07
8	000981	银亿股份	36,657.00	0.07
9	000786	北新建材	33,485.00	0.06
10	600566	济川药业	33,457.00	0.06
11	600004	白云机场	32,142.00	0.06
12	600426	华鲁恒升	31,647.00	0.06
13	600346	恒力股份	30,038.00	0.06
14	600642	申能股份	27,755.00	0.05
15	002078	太阳纸业	27,295.00	0.05
16	002340	格林美	27,294.00	0.05
17	600600	青岛啤酒	26,619.00	0.05
18	601138	工业富联	26,160.00	0.05
19	600160	巨化股份	25,742.00	0.05
20	600808	马钢股份	25,725.00	0.05

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	53,180,966.07
卖出股票收入（成交）总额	5,351,223.89

7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,609,880.00	5.56
	其中：政策性金融债	2,609,880.00	5.56
4	企业债券	4,944,736.60	10.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,554,616.60	16.10

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

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	112362	16泛控02	50,000	4,544,500.00	9.69
2	018005	国开1701	26,000	2,609,880.00	5.56
3	122446	15万达01	4,000	398,320.00	0.85
4	136019	15龙湖04	10	958.70	0.00
5	136465	16国投01	10	957.90	0.00

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

注：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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

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	17,410.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	92,467.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	109,877.80

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股票。

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总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
257	195,849.82	49,999,000.00	99.34%	334,404.42	0.66%

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	80,281.16	0.16%

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	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年5月11日）基金份额总额	200,602,551.05
本报告期期初基金份额总额	50,225,199.27
本报告期基金总申购份额	174,202.16
减：本报告期基金总赎回份额	65,997.01
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	50,333,404.42

§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

本报告期内基金管理人、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

本报告期无基金管理人、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	
兴业证券	1	24,045,196.90	41.10%	22,393.84	41.11%	-
华创证券	1	5,168,743.11	8.83%	4,800.90	8.81%	-
长江证券	1	4,249,313.74	7.26%	3,957.70	7.26%	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	25,045,450.71	42.81%	23,325.00	42.82%	-

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）遵循国家及证券监督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）投资管理部门、市场部门

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门、市场部门、基金运营部及信息技术部的，由专员分别将此内容发送给上述部门审阅，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门、市场部门、信息技术部和监察稽核部签字，最后盖章。

3、本基金报告期内券商交易单元变更情况：

（1）退租券商交易单元：国金证券（396685）

（2）上表中所列交易单元均与浙商聚盈纯债债券型证券投资基金共用。

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
兴业证券	4,945,485.70	28.33%	19,000,000.00	10.31%	-	-
华创证券	-	-	165,250,000.00	89.69%	-	-
长江证券	7,533,594.79	43.15%	-	-	-	-
上海证券	4,979,319.18	28.52%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

浙商基金管理有限公司
2018年8月28日