浙商聚潮新思维混合型证券投资基金

【2013】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:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2014年3月28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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月21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。

毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浙商聚潮新思维混合
基金主代码	166801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月8日
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	64,786,593.97

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘运用经济发展新思维与社会发展新思维实现可持续发展的上市公司的投资机会,在科学管理风险的前提下,追求基金资产的中长期持续稳定增值。
投资策略	本基金采用"自上而下"+"自下而上"相结合的投资策略,主要通过资产配置策略与股票选择策略,优选运用新思维实现可持续发展的上市公司股票,在科学管理风险的前提下构建投资组合,以充分分享中国可持续发展的经济成果,实现组合资产中长期持续稳定增值的投资目标。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
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,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。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	闻震雷	辛洁
	联系电话	0571-28191875	010-58560666
	电子邮箱	wenzhenzhou@zsfund.com	xinjie@cmbc.com.cn
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	95568
传真		0571-28191919	010-58560794

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年3月8日-2012年12月31日
本期已实现收益	54,968,484.57	-29,081,547.19
本期利润	24,481,110.35	3,585,050.72
加权平均基金份额本期利润	0.1899	0.0075
本期加权平均净值利润率	17.45%	0.76%
本期基金份额净值增长率	16.86%	2.00%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	12,440,624.50	-20,450,873.06
期末可供分配基金份额利润	0.1920	-0.0647
期末基金资产净值	77,227,218.47	322,255,126.68
期末基金份额净值	1.192	1.020
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	19.20%	2.00%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

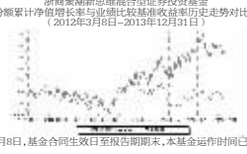
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.67%	0.96%	-1.45%	0.62%	0.78%	0.34%
过去六个月	13.52%	1.10%	3.93%	0.71%	9.59%	0.39%
过去一年	16.86%	1.13%	-2.54%	0.77%	19.40%	0.36%
自基金合同生效日起至今(2012年03月08日-2013年12月31日)	19.20%	0.99%	-2.67%	0.72%	21.87%	0.27%

注:本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照65%、45%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

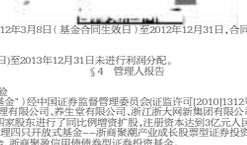
浙商聚潮新思维混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年3月8日-2013年12月31日)



1.本基金基金合同生效日为2012年3月8日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间已满一年。图示日期为2012年3月8日至2012年12月31日。

2.本基金建仓期为6个月,从2012年3月8日至2012年9月7日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金2012年实际运作期间为2012年3月8日(基金合同生效日)至2012年12月31日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

基金自2012年3月8日(基金合同生效日)至2013年12月31日未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浙商基金管理有限公司(简称"浙商基金")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、浙江浙大网新集团有限公司,股权占比各为25%。2012年,经中国证监会(证监许可【2012】837号文)批准,四家股东进行了同比例增资扩股,注册资本达到3亿元人民币。注册地为浙江省杭州市。

截至2013年12月31日,浙商基金共管理四只开放式基金——浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、浙商沪深300指数分级型证券投资基金、浙商聚盈信用债券型证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈志龙	本基金的基金经理、公司投资管理部副总监、投资决策委员会主席、总经理助理、投资管理部总监	2012年3月8日	-	12年	陈志龙先生,特许金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)。曾任中银基金管理有限公司金融投资管理部副总经理、投资决策委员会成员、副总裁、专户理财部投资总监、中银动态策略股票型证券投资基金基金经理。陈志龙先生,浙商基金管理有限公司总经理助理、投资管理部总监、投资决策委员会委员及执行主任,特许金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)。曾任中银基金管理有限公司金融投资管理部副总经理、投资决策委员会成员、副总裁、专户理财部投资总监;并曾担任中银持续增长股票型证券投资基金、中银动态策略股票型证券投资基金基金经理。
张文浩	本基金的基金经理、公司投资管理部研究员本基金基金经理	2012年12月31日	-	8年	张文浩女士,上海社会科学院产业经济学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司证券研究所通信行业研究员,长信基金管理有限责任公司研究员。

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 公平交易制度和控制方法

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;实行集中交易制度,建立了公平的交易分配制度,确保投资组合等有公平的交易权利机会,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,本公司设立了风险控制委员会,对公平的投资决策、对不同投资组合在交易所公开竞价交易中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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.3 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的说明

2013年全年,上证指数、沪深300分别下跌6.75%、7.65%,中小板指数、创业板指数分别上涨17.54%、82.73%;其中2013年下半年上证指数、沪深300、中小板指数、创业板指数分别上涨6.91%、5.88%、11.74%、28.94%。创业板全年相对大盘股大幅度走强,我们认为主要原因有:1)流动性中性略宽松,创业板市值占比小,目前仅占总市值的6%;2)经济复苏实际呈现弱复苏格局,但经济波动性降低,周期股弹性无法持续,反弹周期也很短;3)创业板面临大股东解禁,在连续2-3年业绩低于预期后开始释放业绩;4)公募基金的不断超配,估值提升速度远远超过业绩增长速度;5)经济转型、产业结构调整,新兴产业登场,带动估值的提升。11Q2的下半年,以上市公司面临并购机遇或注册预期;7月份以来,中小板、创业板出现较大多数个股期,并呈低于预期。目前创业板2013年PE 46倍,低于2010年的80倍,但已从年初的30倍大幅提升。

浙商聚潮新思维混合型证券投资基金全年净值上涨16.86%,大幅跑赢上证指数、沪深300分别为23.61%、24.51%;略跑输中小板指数0.68%,大幅跑输创业板指数65.87%。其中下半年净值上涨13.52%,大幅跑赢上证指数、沪深300分别为6.61%、7.64%;略跑赢中小板指数1.78%,大幅跑输创业板指数15.42%。流动性中性偏紧,我们全年均在低仓位下。1月我们净值涨幅领先,2月起增加了TMT、环保、煤化工行业的配置,仍维持医药的超配,降低了金融类股票的配置;5月增加了房地产、券商的配置比例,6月降低地产的配置,7月增加了通信设备的配置,降低了煤化工的配置,8月增加化工配置,并降低医药的配置,9月增加商贸和大众消费品的配置,10月降低了前期涨幅过高的传媒、商贸、大众消费品的配置,增加了高铁、电力设备的配置,11月增加了军工股、电子光其是LED的配置,12月降低了机械、交通运输、军工、建筑、食品饮料的仓位,增加了医药的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日为止,报告期内本基金净值增长率为16.86%,业绩比较基准收益率为-2.54%,基金净值增长率高于业绩比较基准19.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年A股市场的主要矛盾是在市场供给端的变化背景下,改革落实及影响与资金价格高企或者信用风险的矛盾。经济在房地产投资带动下保在底线,但资金成本、劳动力成本高等问题经济增长受压制,经济上有顶下有底,对经济关注度弱化。十八届三中全会召开后改革由顶层明进入推行期,密切关注将对市场的影响,改革制度设计、立足中长期,但或出现短期需支付改革成本,改革在执行环节通常会遇到阻力,短期未必有明显效果等问题。中长期改革能够提升潜在增长率,前途光明,从国际经验看,代表未来发展方向的新经济如技术行业、医疗卫生、消费品等在市场中的市值占比将提升,市场结构将发生变化。

流动性全球角度OE有收缩预期但对大国的影响不如小国强烈,国内央行仍为中性偏紧的态度。2014年下半年到2015年1季度期间,29万亿的信托将面临到期,不排除流动性新冒险性紧张,但或时已重视发生危机可能性小。随利率市场化推进、央行管控、地产和融资平台边际需求的推升资金利率很高下来。

展望全年,我们认为市场供给端有压力,国内流动性中性偏紧,但经济有底,改革加速推进逐步落实,市场震荡仍有结构性行情,需淡化指数重视结构,行业特性不明显,个股选择优于行业配置。2014年1季度实际供给压力不大,流动性从比改善,在全年中较优。

行业层面板有优势的商务主题是:1)安全建设、国企改革、激断垄断或供给端改善、生态安装等改革;a)国家安全战略升级+投资"补欠账"+军工改革、军民融合的军工行业,b)供给端改善的农业行业机点+主改+通胀预期及水泥、部分化工品。c)资本市场改革受益的非银金融,d)国企改革打破垄断+混合所有制经济,业绩估值双升,区域优选城投债比例高的安徽、江苏,以及部分国企改革后的竞争性行业的受化。2)代表转型新经济的优质成长股:如a)互联网打造互消费支柱产业,娱乐传媒、医疗、金融等信息化进程能迎来加速发展期,b)美丽中国:环保产业强纳入考核范围,水务、大气和固废等在投入提升。c)新能源(设备)行业面临阶段性的产能出清,产业要素改革进程中的受益者。d)医药:健康服务等新医药、新模式,如美国医疗市值前列的是麻业医保、医院连锁、透析服务、诊断外包、专科医药、养老机构、康复中心。我们仍认为不论是传统行业还是新兴产业,从中长期角度,配置行业逻辑清晰、企业集中度在提高或依靠原有优势拓展了新的产品新的领域,企业自身体现出抗周期特征,在转型背景下收入强劲、业绩增长较确定的个股,并密切跟踪这类个股的基本面情况。

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,会计师事务所在年终财务报告中出具了无保留意见的审计报告。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金《基金合同》约定:"基金收益分配是指在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的规定。"本基金在本报告期不符合基金收益分配条件,在本报告期未进行收益分配。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

—

§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

中国民生银行股份有限公司(以下简称"民生银行")根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规规定,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;实行集中交易制度,建立了公平的交易分配制度,确保投资组合等有公平的交易权利机会,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,本公司设立了风险控制委员会,对公平的投资决策、对不同投资组合在交易所公开竞价交易中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。

5.2 报告期内本基金托管人对报告期内基金投资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。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由浙商聚潮新思维混合型证券投资基金的基金管理人——浙商基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第1400167号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浙商聚潮新思维混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的第1页至第30页的浙商聚潮新思维混合型证券投资基金(以下简称"浙商聚潮新思维基金")财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表、2013年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是浙商聚潮新思维基金管理人浙商基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证券监督管理委员会(以下简称"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编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价浙商基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,浙商聚潮新思维基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注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编制,公允反映了浙商聚潮新思维基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	王国蓉 罗琼
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市南京西路1266号恒隆广场50楼
审计报告日期	2014-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体:浙商聚潮新思维混合型证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	3,188,100.76	25,692,992.63
结算备付金	1,094,575.21	746,404.48
存出保证金	262,069.96	1,250,000.00
交易性金融资产	47,863,546.80	351,710,489.96
其中:股票投资	37,433,546.80	250,001,489.96
基金投资	-	-
债券投资	10,430,000.00	101,709,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	21,500,000.00	-
应收证券清算款	4,569,695.91	11,258,289.65
应收利息	122,930.89	1,947,552.53
应收股利	-	-
应收申购款	1,182.27	1,289.61
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	78,602,101.80	392,607,018.86

负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	50,000,000.00
应付证券清算款	448,207.32	4,919,963.04
应付赎回款	88,315.58	12,602,865.45
应付管理人报酬	100,191.24	406,049.78
应付托管费	16,698.53	67,674.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	245,693.87	637,494.55
应交税费	25,605.30	-
应付利息	-	48,346.27
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	450,171.49	1,669,498.13
负债合计	1,374,883.33	70,351,892.18
所有者权益:		
实收基金	64,786,593.97	316,066,661.61
未分配利润	12,440,624.50	6,188,465.07
所有者权益合计	77,227,218.47	322,255,126.68
负债和所有者权益总计	78,602,101.80	392,607,018.86

注:1)报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.192元,基金份额总额64,786,593.97份。

7.2 利润表
会计主体:浙商聚潮新思维混合型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日-2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月8日-2012年12月31日
一、收入	31,559,155.03	14,379,975.24
1.利息收入	2,636,144.24	4,593,128.10
其中:存款利息收入	203,396.14	972,870.94
债券利息收入	2,274,869.85	2,121,834.83
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	157,878.25	1,498,422.33
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	59,141,357.52	-23,494,364.20
其中:股票投资收益	54,873,976.16	-27,126,706.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,701,763.48	626,996.95
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	565,617.88	3,005,345.81
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-30,487,374.22	32,666,597.91
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	269,027.49	614,613.43
减:二、费用	7,078,044.68	10,794,924.52
1.管理人报酬	2,141,526.02	5,770,899.23
2.托管费	356,921.06	961,816.61
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,605,232.36	3,557,758.16
5.利息支出	617,924.24	109,466.81
其中:卖出回购金融资产支出	617,924.24	109,466.81
6.其他费用	356,441.00	394,983.71
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	24,481,110.35	3,585,050.72
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	24,481,110.35	3,585,050.72

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:浙商聚潮新思维混合型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日-2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	316,066,661.61	6,188,465.07	322,255,126.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,481,110.35	24,481,110.35
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)	-251,280,067.64	-18,228,950.92	-269,509,018.56
其中:1.基金申购款	2,600,611.81	300,771.30	2,901,383.11
2.基金赎回款	-253,880,679.45	-18,529,722.22	-272,410,401.67
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)	64,786,593.97	12,440,624.50	77,227,218.47

项目	上年度可比期间 2012年3月8日-2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	784,917,869.79	-	784,917,869.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,585,050.72	3,585,050.72
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)	-468,851,208.18	2,603,414.35	-466,247,793.83
其中:1.基金申购款	1,463,072.99	-27,847.03	1,435,225.96
2.基金赎回款	-470,314,281.17	2,631,261.38	-467,683,019.79
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)	316,066,661.61	6,188,465.07	322,255,126.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

周一峰	李俊明	李俊明
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浙商聚潮新思维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")《关于核准浙商聚潮新思维混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]2041号文)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》及其配套规则和《浙商聚潮新思维混合型证券投资基金基金合同》于2012年2月6日至2012年3月5日公开发售,募集资金总额人民币784,917,869.79元,其中扣除认购费后的有效认购资金人民币784,601,312.72元,有效认购资金在募集期间产生利息人民币316,557.07元,共折合784,917,869.79份基金份额。上述募集资金已经毕马威华振会计师事务所审验并出具了KPMG-B(2012)CR No.0010号验资报告。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为浙商基金公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称"民生银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则,《浙商聚潮新思维混合型证券投资基金基金合同》和《浙商聚潮新思维混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围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、债券、权证、资产支持证券、股指期货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。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为30%-80%,其中投资于受益于新思维理念的行业或公司的比例不低于股票资产的90%;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品种占基金资产的比例范围为20%-70%,其中基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,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%。

本基金的股票投资部分的业绩比较基准为沪深300指数、债券投资部分为上证国债指数收益率,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则"),中国证券业协会于2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,《浙商聚潮新思维混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年12月31日的财务状况、2013 年度的经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合财务报表附注7.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4 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。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自2013年1月1日至2013 年12 月31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

人民币

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)均划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产;其他金融资产划分为应收款项,本基金目前暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具产生的金融资产外,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。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债在初始确认时按采用公允价值计量的负债的分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(i) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(ii) 债券投资

买入交易所上或银行间的债券均于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发/有的分离交易可转债于获配日按支付的全部价款确认为债券投资,于权证实际取得日按附注7.4.4.4(a)(iii)所示的方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允价值分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日,按持有的股数及获赠比例计算并记账增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(b) 应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

应收款项以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。其中买出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额,相关交易费用计入初始成本,终止确认或摊销时支出计入当期损益。

(c) 其他金融负债

其他金融负债是指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。

其他金融负债按公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额,相关交易费用计入初始成本,终止确认或摊销时支出计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,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,采用最近交易市价确定公允价值,如估值日无市价,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,处酌考估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,参考类似投资品种的现行市价及重大事件等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,应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,确定投资品种的公允价值。

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。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。

本基金的金融资产和金融负债以上述原则确定的公允价值进行估值,另外对金融资产的特殊情况处理如下:

(a) 股票投资

(i) 对因特殊事项长期停牌的股票,如该停牌股票对基金资产净值无影响,则采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。即在估值日,以公开发布的相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率计算该股票当日的公允价值。

(ii) 送股、转增股、配股和公开增发新股,按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价估值;该日无交易的,以最近一日的收盘价估值。

(iii) 首次公开发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(iv) 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的收盘价估值。

(v) 非公开发行有明确锁定期的股票,若在证券交易所上市的同一股票的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上市的同一股票的收盘价估值;若在证券交易所上市的同一股票的收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,其两者之间的差价按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例确认为估值增值。

(b) 债券投资

(i) 交易所上市实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的收盘价估值,交易所上市未实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的收盘价减去债券应收取自价格支付中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

(ii) 对交易所发行未上市的国债、企业债、公司债,按成本估值;对在交易所发行未上市的可转换证券,自债券确认日至上市期间的每个估值日,按证券业协会下证券投资基金估值工作小组