基金管理人:浙商基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	浙商聚潮产业成长股票
基金主代码	688888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月17日
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	485,197,684.42

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于在国际、国内产业转移与升级过程中具有竞争优势的上市公司股票,在有效控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下,追求基金资产的长期持续稳定增长。
投资策略	本基金基于全球以及中国经济发展过程中产业演进的趋势,挖掘在国际、国内产业转移与升级中具有竞争优势的上市公司股票,以经过初选的沪深A股股票池为基础,采用"自上而下"的分析方法,将定性与定量分析贯穿于大类资产配置、行业配置、股票选择、组合构建以及组合风险管理的全过程之中,依靠坚实的基本面分析和科学的金融工程模型,把握股票市场和债券市场的有利投资机会,构建最佳的投资组合。投资中运用的策略主要包括: 1.大类资产配置策略 宏观经济、政策环境、资金供求和估值水平、市场情绪是决定证券市场运行趋势的主要因素。本基金将深入分析各个因素的运行趋势及对证券市场的作用机制,综合分析评判证券市场中股票、债券等各类资产风险收益特征的相对变化。在此基础上,在投资比例限制范围内,适时动态地调整股票、债券等资产的比例。 2.股票投资策略 把握产业转移和产业升级的驱动力是本基金的投资逻辑,而那些能够体现这种特征的具体行业及其企业是本基金的投资对象。 3.债券投资策略 为降低基金投资的系统性风险,本基金将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标,同时根据需要适度积极操作,进行债券投资,以提高基金收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于主动投资的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	闻震雷	李芳菲
	联系电话	0571-28191875	010-66060069
	电子邮箱	wenzhenzhou@zsfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	95599
传真		0571-28191919	010-63201816

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	2011年5月17日-2011年12月31日
本期已实现收益	42,464,384.60	-80,184,210.02	-89,452,601.50
本期利润	-3,311,522.69	52,951,810.18	-164,349,018.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0057	0.0674	-0.1482
本期加权平均净值利润率	-0.63%	7.83%	-15.48%
本期基金份额净值增长率	-1.77%	7.76%	-16.20%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	-55,813,221.40	-123,432,646.27	-147,374,631.77
期末可供分配基金份额利润	-0.1150	-0.1771	-0.1620
期末基金资产净值	430,557,422.66	629,298,500.24	762,358,582.53
期末基金份额净值	0.887	0.903	0.838
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	-11.30%	-9.70%	-16.20%

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	-3.06%	1.20%	-2.25%	0.84%	-0.81%	0.36%
过去六个月	0.57%	1.16%	4.85%	0.97%	-4.28%	0.19%
过去一年	-1.77%	1.27%	-4.73%	1.04%	2.96%	0.23%
自基金合同生效日起至今(2011年05月17日-2013年12月31日)	-11.30%	1.11%	-16.66%	1.00%	5.36%	0.11%

注:本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

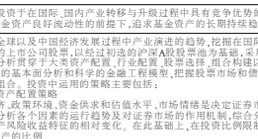
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照75%、25%的比例来取再平衡,再用每日连乘的计算方式将则基准指数的时间序列。

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

浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金

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

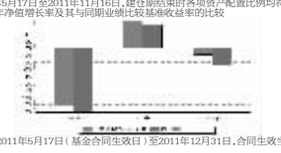
(2011年5月17日-2013年12月31日)



注:1.本基金基金合同生效日为2011年5月17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2011年5月17日至2011年11月16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2011年实际运作期间为2011年5月17日(基金合同生效日)至2011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

本基金自2011年5月17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)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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜培正	投资管理部副总监、研究总监	2011年5月17日	-	9年	华东师范大学政治经济学硕士,美国华威大学经济和金融理学硕士。具备基金从业资格。历任平安证券综合研究所研究员;国联安基金研究部研究员;现任浙商基金管理有限公司投资管理部副总监兼研究总监。
方维	本基金基金经理、行业研究员	2012年12月31日	-	6年	2008年1月至2009年6月在天相投资顾问有限公司证券投资部担任机械行业研究员。于2011年4月至我公司投资管理部担任行业研究员、基金经理助理。具备基金从业资格。

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》、《证券投资基金管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法规规定,本公司制定了规范的公平交易制度。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时间段内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和运作分析

宏观经济

一季度宏观经济出现了"弱复苏"迹象。一季度CPI同比增长2.4%,PPI同比下降1.6%。1、2、3月份的汇率中国制造业PMI始终稳定于50%的"荣枯平衡线"之上,分别为52.3%、50.4%、51.6%。一季度GDP同比增长7.7%(环比长1.6%),工业增加值同比增9.5%,全社会用电量和货运量同比增长4.3%,出口同比增长4%,进口同比增长18.4%,贸易顺差430.73亿美元,社会消费品零售总额同比增长12.4%,FDI同比增1.44%,固定资产投资同比增20.9%,房地产开发投资同比增20.2%,商品房销售额同比增61.3%。一季度社会融资规模6.16万亿元,其中新增贷款2.76万亿元,一季度末M2余额突破百万亿元规模达108.61万亿元,同比增15.7%。一季度末人民币新增12.15万亿元。

二季度宏观经济运行态势虽现下行趋势。上半年CPI同比增长2.4%,PPI同比下降2.2%。4、5、6月份的汇率中国制造业PMI逐月下行并跌破50%的"荣枯线"水平,分别为50.4%、49.2%、48.2%。一季度末GDP同比增7.6%(二季度GDP同比增7.5%),工业增加值同比增9.3%,全社会用电量同比增5.1%,出口同比增长0.7%,贸易顺差107.05亿美元,社会消费品零售总额同比增11.4%,FDI同比增4.9%,固定资产投资同比增20.1%,房地产开发投资同比增20.3%,商品房销售额同比增43.2%。上半年社会融资规模10.15万亿元,其中新增贷款5.08万亿元,二季度末M2余额106.45万亿元,同比增14.0%。二季度外汇占款增加3200.11亿元。

三季度宏观经济出现了明显的企稳复苏迹象。前三季度CPI同比增长2.5%,PPI同比下降2%。7、8、9月份的汇率中国制造业PMI触底回升并重回50%的"荣枯线"水平之上,分别为47.7%、50.1%、50.2%。前三季度GDP同比增7.7%(三季度GDP同比增7.8%),工业增加值同比增9.6%,全社会用电量同比增7.2%,出口同比增8%,进口同比增7.3%,贸易顺差1694亿美元,社会消费品零售总额同比增12.9%,FDI同比增6.2%,固定资产投资同比增20.2%,房地产开发投资同比增19.7%,商品房销售额同比增33.9%。前三季度社会融资规模13.96万亿元,其中新增贷款7.28万亿元,三季度末M2余额107.74万亿元,同比增14.2%。三季度外汇占款增加1202.08亿元。

四季度宏观经济数据较三季度有所回落,但仍较为平稳。2013年CPI同比增2.6%,PPI同比下降1.9%,通胀有所抬头但仍可控,而工业品价格潜有起色。10、11、12月份的汇率中国制造业PMI分别为50.9%、50.8%、50.5%,反映中国的制造业景气程度虽较三季度有所回落但仍在荣枯线50%水平之上。1-11月工业增加值同比增9.7%,全社会用电量同比增7.5%,出口同比增3.4%,贸易顺差2341.46亿美元,社会消费品零售总额同比增13.0%,FDI同比增5.48%,房地产开发投资同比增19.9%,房地产开发投资同比增19.5%,固定资产投资同比增20.7%。1-11月社会融资规模16.06万亿元,其中新增贷款8.41万亿元,11月末M2余额107.93万亿元,同比增14.2%。1-11月新增外汇占款。四季度(不含12月)外汇占款增加8395.49亿元。

自2012年12月以来,"热钱"流出中国的趋势发生逆转。宏观经济开始企稳,日本安倍政府推出量化宽松政策刺激了国际资本回流中国。2013年1-4月的外汇占款余额增加额分别为6837亿元、2956亿元、2363亿元、2944亿元,这客观推动了国内广义流动性的变化。

但受外资持续打市虎智囊另,美联储逐步退出QE,日元走强突然袭击日本,日本股市大幅下跌"出现"流出"的趋势,5月外汇占款增加额从前几个月的数十亿级别下降至不到1000亿元,6、7月份外汇占款余额为净减少,8月份出现增加273.2亿元。在这一大背景下,4月上旬银行放贷过猛导致月末存款比率接近考核可能被超达标,而央行又未及时市场预期将商业银行及时提供流动性,这将因素最终导致6月下旬银行间拆借利率急剧走高,市场流动性一度异常紧张。

6月份银行间市场出现"钱荒"之后随着央行出手救市,全市场流动性紧张的问题开始得到逐步缓解。海外市场方面,美联储QE退出过程也较为缓慢,这也减轻了中国资金外流的压力。但是10年期国债收益率在三季度攀升至4%以上,流动性总体趋紧的局面一直没有得到改善。

四季度对市场影响最大的事件无疑是中共18届三中全会提出了全面深化改革的一系列重大举措,极大提振了市场信心,但临近年末资金面的再度紧张以及IPO明确将于2014年1月重启则对市场构成了较大的利空。

市场表现

一季度上证指数下跌1.43%,沪深300指数下跌1.10%,创业板指数上涨21.38%,中小板指数上涨7.70%。从风格角度来看,医药、消费电子、环保、LNG板块为代表的中小市值成长类股票表现明显好于以金融地产、汽车、煤炭有色等为代表的周期类蓝筹股。

二季度市场分化程度进一步加剧。表征宏观经济走向的沪深300指数下跌11.8%,而象征着"中国经济结构转型"的创业板指数和中小板指数则表现出异样,前者上涨16.76%,后者仅下跌2.82%。

由于宏观经济走势趋弱,房价上涨又导致地产调控政策预期加剧,加之6月下旬出现的流动性紧张局面,以金融、房地产、煤炭、有色等周期性板块为代表的大盘蓝筹股二季度均表现不佳。相对而言,资金更青睐于象征经济结构转型,成长前景较为明朗,体现"中国梦"的中小市值成长股,其中以传媒、消费电子、环保、新能源等板块最有代表性。

三季度A股市场强劲反弹,随着宏观经济的企稳回升,以金融地产等蓝筹股为主要成份的沪深300指数涨幅达到9.47%,而象征中国经济结构转型的中小市值成长类股票涨幅更加惊人,中小板综合指数涨幅为20.59%,创业板指数涨幅更是达到了惊人的35.21%并连创历史新高。行业板块来看,三季度涨幅居前的是传媒、商贸零售(涉足互联网概念)、上海自贸区板块,而传统的周期性行业板块涨幅有限。

四季度A股呈现跌、涨、跌的走势,10层三中全会公报的文件内容不及预期,全面深化改革后引之后强势反弹,12月资金面紧张以及IPO开闸明确之后又重新回落。四季度沪深300指数跌3.28%,中小板综指为涨0.10%,创业板综指涨1.17%。

全年来看,沪深300跌7.65%,中小板综合指数涨26.34%,创业板综合指数涨74.73%。2013年A股的结构分化异常明显,象征中国经济转型的中小市值成长类股票对资金的吸引力远高于低估值蓝筹类品种,全年涨幅居前的板块是传媒、医疗器械、计算机软件服务,跌幅居前的板块是煤炭、有色、钢铁。

基金操作

2013年全年本基金在大类资产配置方面基本保持稳定。

一季度本基金由重点配置了金融、地产、医药、建筑建材等行业,并逐渐加大对"TMT"、医药、清洁能源等成长类板块的配置比重。

二季度本基金降低了金融行业和周期性行业的配置比重,加大了对TMT、医药、清洁能源等成长类板块的配置比重。

三季度本基金重新加大对低估值蓝筹板块的配置比重,包括金融、地产、汽车等,同时加大了对食品行业的配置,降低了TMT、医药等行业的配置比重。

四季度本基金重点配置了金融、食品饮料和医药等板块。

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-1.77%,业绩比较基准收益率为-4.73%,基金净值增长率高于业绩比较基准2.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济

预计2014年全年GDP增速的将维持在7%-7.5%水平。随着"调结构"的深化展开,预计2014年经济总量的增速较2013年趋缓但仍将保持在7%左右的水平。金融领域,政府以及央行近期的重点将是控制债务规模,资金面紧张程度短期内仍难以缓解。

市场展望

在经济结构转型,政府和央行严控债务规模,资金面紧张程度短期内仍难以缓解的大背景下,A股在2014年一季度缺乏指数性扩情的机会。新股发行制度改革中提出的市值申购制度,以及中小市值成长股主要集中在深圳市场等因素,将会继续推动A股市场"深强沪弱"的格局。1月份新股扎堆IPO,一定程度将分流股市的存量资金,尤其是新股集中上市之后中小市值成长股面临一定的利空。但全年来看,在"结构转型"的大背景下,中小市值成长股较低估值蓝筹股对资金的更有吸引力。

基金操作

2014年一季度本基金将继续关注具有可持续成长性的优秀公司,积极挖掘受益于经济转型的板块机会,重点布局医药、食品饮料、LED、环保、油服等行业。

4.6 管理人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

根据本基金《基金合同》约定,"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

在托管浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金合同》、《浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金托管协议》的约定,对浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金管理人-浙商基金管理有限公司在2013年1月1日至2013年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督、认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,浙商基金管理有限公司在浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 管理人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

本托管人认为,浙商基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

姓名	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1400166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	浙商聚潮产业成长股票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页的浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金(以下简称"浙商聚潮产业成长基金")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产业成长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,并使其不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 6月份银行间市场出现"钱荒"之后随着央行出手救市,全市场流动性紧张的问题开始得到逐步缓解。海外市场方面,美联储QE退出过程也较为缓慢,这也减轻了中国资金外流的压力。但是10年期国债收益率在三季度攀升至4%以上,流动性总体趋紧的局面一直没有得到改善。 四季度对市场影响最大的事件无疑是中共18届三中全会提出了全面深化改革的一系列重大举措,极大提振了市场信心。但临近年末资金面的再度紧张以及IPO明确将于2014年1月重启则对市场构成了较大的利空。
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,浙商聚潮产业成长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及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产业成长基金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	王国喜 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	上海南京西路1266号恒隆广场50楼
审计报告日期	2014-03-27

浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	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		30,880,797.63	52,859,435.79
结算备付金		1,332,890.79	1,740,020.84
存出保证金		355,961.59	2,250,000.00
交易性金融资产		368,866,537.82	616,388,010.03
其中:股票投资		360,267,645.42	554,733,910.03
基金投资		-	-
债券投资		8,598,892.40	61,654,100.00
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		25,000,000.00	-
应收证券清算款		6,447,914.60	392,296.67
应收利息		42,280.11	1,455,092.84
应收股利		-	-
应收申购款		4,236.46	593.78
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		432,930,619.00	675,085,449.95
负债和所有者权益	附注号	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		-	20,000,000.00
应付证券清算款		-	19,430,184.58
应付赎回款		562,909.57	1,198,102.72
应付管理人报酬		553,115.88	760,023.46
应付托管费		92,185.97	126,670.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		537,832.06	1,435,996.45
应交税费		137,000.00	-
应付利息		-	15,066.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		490,152.86	2,820,905.27
负债合计		2,373,196.34	45,786,949.71
所有者权益:			
实收基金		485,197,684.42	696,811,473.77
未分配利润		-54,640,261.76	-67,512,973.53
所有者权益合计		430,557,422.66	629,298,500.24
负债和所有者权益总计		432,930,619.00	675,085,449.95

7.2 利润表

会计主体:浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日-2013年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31日
一、收入		11,907,651.86	73,547,918.56
1.利息收入		2,350,789.65	1,984,542.04
其中:存款利息收入		469,117.21	959,611.36
债券利息收入		1,734,018.25	824,186.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		147,654.19	200,743.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失"-"填列)		55,204,688.31	-61,774,260.42
其中:股票投资收益		49,431,532.66	-67,444,921.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益		732,795.22	28,276.16
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		5,040,360.43	5,642,384.52
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-45,775,907.29	133,136,020.20
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		128,081.19	201,616.74
减:二、费用		15,219,174.55	20,596,108.38
1.管理人报酬		7,938,934.76	10,172,974.84
2.托管费		1,323,155.94	1,695,495.88
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		5,441,919.58	8,224,913.76
5.利息支出		45,586.09	53,693.31
其中:卖出回购金融资产支出		45,586.09	53,693.31
6.其他费用		469,578.18	449,030.59
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-3,311,522.69	52,951,810.18
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-3,311,522.69	52,951,810.18

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金

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)	696,811,473.77	-67,512,973.53	629,298,500.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,311,522.69	-3,311,522.69
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)	-211,613,789.35	16,184,234.46	-195,429,554.89
其中:1.基金申购款	15,801,867.37	-1,423,981.84	14,377,885.53
2.基金赎回款	-227,415,656.72	17,608,216.30	-209,807,440.42
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)	485,197,684.42	-54,640,261.76	430,557,422.66
	上年度可比期间 2012年1月1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)	909,733,214.30	-147,374,631.77	762,358,582.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	52,951,810.18	52,951,810.18
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)	-212,921,740.53	26,909,848.06	-186,011,892.47
其中:1.基金申购款	25,366,411.75	-3,458,695.81	21,907,715.94
2.基金赎回款	-238,288,152.28	30,368,543.87	-207,919,608.41
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)	696,811,473.77	-67,512,973.53	629,298,500.24

注:市场附注为财务会计报表的组成部分

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:

周一锋	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 投资组合

7.4.1 基金基本情况

浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金(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")《关于核准浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]267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《浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金合同》发售,基金合同于2011年5月17日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。首次设立募集规模为1,270,937,738.23份基金份额。本基金的基金管理人为浙商基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司以下简称"农业银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则,《浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金合同》和《浙商聚潮产业成长股票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,包括国内依法发行和上市交易的股票(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、货币市场工具、股指期货、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的比例范围为:股票资产60%-95%,债券资产0%-35%,权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%,现金或到期日在1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×75%+上证国债指数收益率×25%。

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的办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金按照中华人民共和国财政部颁以下简称"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6月颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,《浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金合同》,《浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金托管协议》的约定,对浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金管理人-浙商基金管理有限公司2013年1月1日至2013年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督、认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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如财务报表附注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。

7.4.5 会计差错更正的说明

本基金报告期会计年度自2013年1月1日至2013年12月31日止。

7.4.6.2 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本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。除衍生工具所产生的金融资产、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。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。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为: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、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