

2014 半年度报告摘要

2014 半年度报告摘要[illegible]

其他资产					
其他资产	6.4.7.6	30,247.08			
资产总计		63,976,030.34		92,941,677.32	
负债和所有者权益	附注号				
		本期末 2014年06月30日		上年度末 2013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		-		-	
应付短期融资款		5,675.56		-	
应付账款		-		53,135.37	
预收账款/预缴入垫款		52,337.86		61,358.54	
应付工资		11,514.33		17,898.90	
应付福利费/应付福利费		-		-	
应付工资费用	6.4.7.7	29,204.45		18,506.30	
应交税费		-		-	
应付利息		-		-	

[illegible]

单位:人民币元			
项目	附注	本期2014年6月30日—2014年6月30日	上年度可比期间2013年6月1日—2013年6月30日
一、收入		-5,052,990.22	-8,937,392.31
1.利息收入		18,893.46	32,962.62
其中:存款利息收入	6.4.7.11	18,893.46	32,962.62
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)		-2,447,326.29	6,982,271.93
其中:股权投资收益	6.4.7.12	-3,184,130.08	5,685,661.15
基金投资收益		—	—
资产处置收益	6.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	—	—
金融衍生收益		—	—
汇兑损益	6.4.7.14	—	—
公允价值变动损益	6.4.7.15	736,903.78	1,786,610.78

关联名称

浙商基金管理有限公司

与基金的关系

基金管理、基金销售机构

4.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6,473.16	-22,649,300.67	-16,649,718.29	华夏银行股份有限责任公司	基金管理人、基金销售机构		
4.1.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)				招商局资本管理有限责任公司	基金管理人、基金销售机构		
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6,473.17	25,373.30	97,991.43	通惠资产管理有限责任公司	基金管理人、基金销售机构		
5.1.其他收入		847,537.79	1,234,499.49	浙江大舜集团有限公司	基金管理人、基金销售机构		
5.1.1.手续费收入		386,317.33	626,123.41	永亮资产管理公司	基金管理人、基金销售机构		
5.1.2.托管费		85,407.77	137,813.37	注：以下关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款签订。 6.4.B.1 通过关联方交易单元进行的交易 6.4.B.1.1 权证交易 本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行权证交易。 6.4.B.1.2 权证交易 本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行权证交易。 6.4.B.1.3 应收关联方款项 本基金本报告期及去年同期均没有应收关联方款项。 6.4.B.1.4 应付关联方款项 本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行应付的款项。 6.4.B.2 基金管理人 本基金本报告期及去年同期均未通过关联方交易单元进行委托的申购。 6.4.B.2.1 基金管理人			
5.1.3.销售服务费							
4.交易费用	6,473.18	68,670.96	179,151.43				
5.利息支出							
其中：卖出回购金融资产支付							
其中：利息支出(净支出以“-”号填列)	6,473.19	398,241.71	301,110.36				
其中：卖出回购(净支出以“-”号填列)		-3,900,527.99	-10,181,891.50				
减：所得税费用							
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-3,900,527.99	-10,181,891.50				

注：主体：招商广证0号指数分级证券投资基金 本报告期：2014年01月01日—2014年06月30日				
单位：人民币元				
项目	本期 2014年01月01日—2014年06月30日		上期可比期间 2013年01月01日—2014年06月30日	
一、期初所有者权益(基金净值)	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
1. 期初所有者权益(基金净值)	103,773,118.09	-10,452,037.65	93,285,077.44	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(净利润)		-5,900,527.99	-5,900,527.99	
三、本期基金份额持有人分配的基金净值变动数(净利润减少以“-”号填列)				
四、本期基金份额持有人的基金净值变动数(净值增加以“+”号填列)	-28,079,565.62	4,247,125.52	-23,832,440.10	
其中：A类申购款	2,084,798.85	-345,302.40	1,739,496.45	
2. 基金赎回款	-30,164,365.47	4,592,427.92	-25,571,877.55	
五、本期基金份额持有人应分配利润产生基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
六、期末所有者权益(基金净值)	75,687,549.47	-12,108,440.12	63,582,109.35	
项目	上期可比期间 2013年01月01日—2014年06月30日		上期可比期间 2013年01月01日—2014年06月30日	
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
当期发生的基金净值的管理费		388,217.23	388,217.23	
其中：支付销售机构为客户维护费		12,591.43	12,591.43	
注：支付给管理人招商基金的基金管理费按前一日基金资产净值10%的年费率计提，每日计提，按月支付。 计算公式为：本基金管理费=前一日基金资产净值×10%÷当年天数 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。 6.8.2.2 基金托管费				
项目	本期2014年01月01日—2014年06月30日		上期可比期间 2013年01月01日—2014年06月30日	
当期发生的基金净值支付的托管费		85,407.77	85,407.77	
注：支付给管理人华安理财的基金托管费按前一日基金资产净值的22‰的年费率计提，每日计提，按月支付。 计算公式为：基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%÷当年天数 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。 6.8.2.3 销售服务费 本基金不收取销售服务费。 6.8.2.4 与支付进行银行间市场的债券回购交易 本基金在银行间市场与全国银行间同业拆借中心进行债券回购交易。				

[illegible][illegible][illegible][illegible][illegible]

<p>(五) 权证投资</p> <p>1、首次公开发行上市前的权证，采用估值技术确定公允价值，存在估值技术上难以可靠计量公允价值的情况下，按照成本计价。</p> <p>2、首次公开发行上市后的权证，采用估值技术确定公允价值，存在估值技术上难以可靠计量公允价值的情况下，按照公允价值计价；如估值技术难以可靠计量，则按成本计价。</p>	<p>7.2.2 报告期末，新银股权投资（行业子母）的股票投资组合 本基金本报告期末未持有新银股权投资。</p> <p>7.2.3 报告期末公允价值占净值比例大于等于 5% 的股票投资组合说明 7.3.1 期末指数投资收益公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资说明</p>
--	--

基金本报告期内期末未持有受限投资资产				
报告期内除权及派息后投资组合重大变动				
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	000016	民生银行	430,560.00	0.46
2	600513	贵州茅台	248,471.40	0.27
3	002088	永新股份	172,649.00	0.19
4	000693	盛康股份	170,720.00	0.18
5	000048	保利地产	166,611.00	0.18
6	000001	平安银行	155,261.00	0.17
7	600000	浦发银行	148,447.00	0.16
8	600930	中信证券	135,416.00	0.15
9	002400	齐川股份	132,900.02	0.14
10	000538	云南白药	127,814.00	0.14
11	000917	电力传媒	127,065.00	0.14

2. 计算出超额超出期初金融资产净值2%或前20位的股票明细				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	占期初金融资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	1,286,420.94	1.38
2	601318	中国平安	1,028,090.70	1.30
3	600036	招商银行	914,063.40	0.98
4	600000	浦发银行	687,532.32	0.74
5	601166	兴业银行	619,159.91	0.66
6	600519	贵州茅台	444,539.01	0.47
7	600837	海通证券	429,943.46	0.46
8	000651	格力电器	425,519.60	0.46
9	000002	万科 A	408,880.35	0.44
10	600328	招商银行	392,476.53	0.44
11	000033	美的集团	392,327.29	0.43
12	600000	中信证券	392,715.38	0.42
13	601288	农业银行	355,168.71	0.38
14	600048	保利地产	322,446.34	0.35
15	000001	平安银行	285,563.09	0.31
16	601601	中国太保	284,749.42	0.31
17	601398	工商银行	284,360.48	0.30
18	000538	云南白药	273,429.12	0.29
19	600887	伊利股份	266,096.17	0.29

[illegible]

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,843.36
2	应收证 券清算款	26,914.13
3	应收股利	-
4	应收利息	778.98
5	应收申购款	497.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.08
8	其他	-

份额类别	持有人数 (人)	户均持有的基金份额	持有人的结构			
			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
浙商创投	100	21,081.091	-	-	2,106,109.08	100.00%
浙商资管	212	11,478.76	-	-	2,106,110.00	100.00%
浙商资产300 指数基金	862	88,801.85	15,469,984.99	20.39%	60,387,594.73	79.61%
合计	1,163	68,847.63	15,469,984.99	19.21%	64,593,913.73	80.68%

注：浙商资产300、浙商稳盈策略混合债转股，以例的份均采用各自类别的份额；对于上述三类的份采用期未基金份额。

序号	持有人在名称	持有人名称	持有股份(份)	占上市总股份比例
1		梁金鋒	300,000.00	7.12%
2		代弟	272,400.00	6.47%
3		張秋賢	201,534.00	4.78%
4		梁乃江	118,232.00	2.81%
5		吳卓新	111,839.00	2.66%
6		張洪	106,234.00	2.52%
7		伊達文	98,300.00	2.33%
8		張愛蓮	84,536.00	2.01%
9		阮永貴	67,466.00	1.64%
10		鄧玲	51,199.00	1.22%

序号	持有人在名称	持有人名称	持有股份(份)	占上市总股份比例
1		代弟	272,400.00	6.47%
2		楊瑞英	182,387.00	4.33%
3		王曉莉	123,133.00	2.92%

4	诺德普	109,851.10	2.61%
5	金峰	100,000.00	2.37%
6	仲泰类	90,000.00	2.14%
7	欣荣普	65,846.60	1.56%
8	永鼎	48,721.00	1.16%
9	盛平	47,000.00	1.12%
10	欣荣铸	44,000.00	1.04%

期末基金管理人从业人員持有本基金的概况

项目	份额级别	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	浙商稳健	-	-
	浙商进取	-	-
	浙商沪深300指数分级	62,889.42	0.08%
	合计	62,889.42	0.08%

对于浙商沪深300、浙商稳健和浙商进取份额,比例的分子采用各自级别的份额;对于合计,比例的分子采用期末基金总份额总额。期末基金管理人从业人員持有本开放式基金各份额总额情况

项目	持有基金份额总量的数量(万股)
浙商稳健	0
浙商进取	0

本基金基金管理人持有开放式基金	浙商沪深300指数 分级	0至10万份(含)	
	合计	0至10万份(含)	
	浙商稳健	0至10万份(含)	
	浙商进取	0	
	浙商沪深300指数 分级	0	
	合计	0	

§9 开放式基金份额变动

	浙商稳健	浙商进取	浙商沪深300指数 分级
基金合同生效日(2012年05月07日)基金份额总额	9,136,705.00	9,136,706.00	336,091,124.17
本报告期初基金份额总额	11,822,650.00	11,822,651.00	82,394,292.76
本报告期基金总申购份额	671,825.00	671,825.00	26,739,296.69
减:本报告期基金总赎回份额	10,388,366.00	10,388,366.00	33,275,941.93
本报告期基金份额变动总额			
本报告期基金净申购份额	2,106,109.00	2,106,109.00	73,857,579.72

此报告期末本基金总资产2,106,109.00元,负债总额0.00元,净资产2,106,109.00元。其中:本报告期末基金份额持有人持有的基金份额为2,106,109.00份,基金份额净值为1.00元。

§ 10 重大事件揭示

基金管理人持有大会决议

期间为基金份额持有人大会决议

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

期间,基金管理人无重大人事变动

涉及基金管理人、基金资产、基金业务等的诉讼、仲裁事项

报告期内基金管理人、基金资产、基金业务没有发生诉讼事项。

会计师事务所的改选

报告期内基金会计师事务所未发生变更。

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。

管理人、托管人及其他高级管理人员受调查或处罚情况

基金管理人、托管人及其他高级管理人员没有发生违法违规被调查或处罚的情形。

本期基金累计及最高交易单元交易的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易 成交金额	占股票 成交总 金额比 例	债券交易 成交金额	占债券 成交总 金额比 例	权证交易 成交金额	占权证 成交总 金额比 例	固定收益 证券的 成交金额	占固定 收益证 券的总 额比例	备注
国泰君安	25	25,803,216.54	68.89%					25,803,724	68.90%	—

新嘉坡	11,654, 286.61	31.11%	-	-	-	-	-	-	10, 610.42	31.10%
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

1. 券商与交易对手方选择标准:

(1) 经中国证监会正式登记注册, 且其交易对手供本基金证券买卖专用, 选择标准为:

- ① 遵循国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定及要求;
- ② 维持时有人员驻场, 不利用基金资产进行利益输送, 不谋求交易佣金;
- ③ 以审慎原则选择作为固定选择和佣金分配的机构。

2. 券商与交易对手方选择程序:

- (1) 投资管理人、市场部
- (2) 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供应商的选择标准, 并参考中央交易室主管的建议, 确定新基金公司拟选择的券商及其服务内容及主席位。
- (3) 由市场部管理维护标准。

④ 中央交易室

3. 券商与交易对手方选择流程:

首先我司提供询价的议和交易商的条件, 其内容包含但不限于资质、信誉、合规保障等, 由专员分别将以上内容送还上海部门中负责我司与券商沟通及跟踪的意见并与券商进行商议, 形成一致意见后完成风控审批, 交公司合规部审核批准。然后由上海部门将符合要求的文本递交给基金文本进行签字盖章。我公司签署完合同后, 专员分别送还投资管理部、市场部、运营部及基金文本券商交易单元变更事项。

租用券商交易单元未发生交易记录。

浙商基金管理有限公司
二〇一四年八月二十七日