

信息披露 Disclosure

浙商沪深300指数分级证券投资基金 [2015]第四季度报告

基金管理人:浙商基金管理有限公司
基金托管人:华泰银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

§ 1 重要提示

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	102,972,052	0.09	
B 采掘业	1,988,302,029	3.26	
C 制造业	10,641,004,053	30.07	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,398,501,26	3.03	
E 建筑业	2,240,705,02	3.07	
F 批发和零售业	1,272,371,35	2.08	
G 交通运输、仓储和邮政业	2,069,702,05	3.39	
H 餐饮业	-	-	
I 住宿业	3,560,071,714	5.63	
J 信息传输、软件和信息技术服务业	20,054,707,021	32.05	
K 研究和试验发展	3,101,040,01	5.03	
L 监理业	602,040,053	0.97	
M 科学研究、技术服务及地质勘查业	406,762,00	0.61	
N 未列明的农、林、牧、渔业	-	-	
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-	
P 教育	-	-	
Q 卫生和社会工作	73,496,00	0.12	
R 文化、体育和娱乐业	1,056,830,04	1.73	
S 其他服务业	340,364,02	0.66	
合计	97,949,168,19	94.03	

5.2.1.2 报告期末(杠杆投资)按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的股票投资组合。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资按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	600131	中国平安	64,128	2,306,600,00	3.78
2	600016	民生银行	1,703,632,60	2.79	
3	601166	兴业银行	79,345	1,864,410,15	2.22
4	600009	招商银行	68,036	1,240,150,64	2.03
5	000002	万科A	40,200	1,179,724,70	1.03
6	600000	浦发银行	66,579	1,015,420,35	1.66
7	601328	中信银行	46,569	901,110,15	1.48
8	600037	海通证券	47,000	767,020,38	1.24
9	601288	农业银行	226,500	720,280,04	1.19
10	601318	中国太保	-	-	-

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小变动份额

本基金本报告期末未持有份额。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.11 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。

5.12 自基金合同生效以来基金分拆情况

本基金分拆后每份基金份额净值为1.00元。

5.13 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

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点。

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

本基金沪深300指数分级拆分变动份额

份额累计净值增长率与业绩比较基准净值收益率对比图

(2012年05月07日-2015年12月31日)

注:1.本基金基金合同生效日为2012年5月7日,基金合同生效日至本报告期末,本基金生效时间已满一年。
2.本基金建仓期为6个月,从2012年5月7日至2012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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 任日期 离任日期 说明

陈晓峰 基金经理 2016年01月01日 -

曾晓峰先生,香港中文大学财务学博士,时任浙商基金管理有限公司研究员。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守信守情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,其基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等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》、《证券投资基金监督管理条例》、《证券投资基金销售机构内部控制指导意见》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、独立运作;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,严禁不同时段不同投资组合之间利益输送;在监控和评估层面,本公司健全人工和系统两个层面的公平交易监控机制,对不同投资组合进行公平交易监控和异常交易监控,并定期向监察稽核部汇报,及时发现并纠正不公平交易行为,对不同投资组合之间的不公平交易行为进行监控,同时对不同投资组合综合防范交易时机和交易价格差异进行监控,同时对不同投资组合综合防范交易时机和交易价格差异进行监控。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 报告期内本基金的报备情况

本基金本报告期无报备。

4.5 报告期内基金的绩效表现

本基金本报告期无报备。

4.6 报告期内基金资产净值增长率偏离度情况

本基金报告期内所有数据均符合基金合同规定的偏离度标准。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

宏观经济的稳定性将依然存在,管理层将在两方面继续进行调控。一是改革,释放经济活力;二是财政政策发力,避免经济失速。但要注意经济下滑对冲政策效果的不确定性,导致经济阶段性出现一定波动,进而使得资本市场出现较大的波动。管理各种风险将是本基金运作的重要内容之一。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产的比例(%)
1	权证投资	10,949,168,19	94.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	货币市场基金	-	-
5	银行存款	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	2,030,072,07	4.77
9	合计	61,473,202,45	100.00

5.2 基金资产净值表现

5.2.1 本基金报告期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

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点。

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

本基金沪深300指数分级拆分变动份额

份额累计净值增长率与业绩比较基准净值收益率对比图

(2012年05月07日-2015年12月31日)

注:1.本基金基金合同生效日为2012年5月7日,基金合同生效日至本报告期末,本基金生效时间已满一年。
2.本基金建仓期为6个月,从2012年5月7日至2012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。

§ 6 开放式基金份额变动

6.1 报告期内基金持有人数及基金资产净值变动情况

本基金本报告期无持有人数及基金资产净值变动情况。

6.2 报告期内基金交易份额变动情况

本基金本报告期无交易份额变动情况。

6.3 报告期内基金投资组合平均数

本基金本报告期无投资组合平均数。

6.4 报告期内基金投资组合平均数

本基金本报告期无投资组合平均数。

6.5 报告期内基金投资组合平均数

本基金本报告期无投资组合平均数。

6.6 报告期内基金投资组合平均数

本基金本报告期无投资组合平均数。

6.7 报告期内基金投资组合平均数

本基金本报告期无投资组合平均数。

6.8 报告期内基金投资组合平均数

本基金本报告期无投资组合平均数。

6.9 报告期内基金投资组合平均数

本基金本报告期无投资组合平均数。

6.10 报告期内基金投资组合平均数

本基金本报告期无投资组合平均数。

6.11 报告期内基金投资组合平均数