

信息披露 Disclosure

浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金

[2016] 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:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2017年1月20日

\$ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同约定，于2017年1月18日复核了本报告中的财务数据、净值表现和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。

本报告未经财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

\$ 2 基金产品概况

基金名称	浙商聚潮策略配置混合
交易代码	680001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月14日
报告期末基金份额总额	267,560,086.58份

本基金通过密切关注市场动态，挖掘不同经济周期阶段下优势资产进行投资机会，追求基金资产的长期稳健增值。

本基金运用定量和定性分析相结合的方法，深入研究宏观经济形势和行业发展趋势，通过分析宏观经济形势下的资产配置时机和投资品种，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，力求获得较基准的投资收益。

本基金将通过深入研究宏观经济形势和行业发展趋势，以增强收益，未来，随着证券市场的健康发展，基金工具在新的交易方式的推动下，基金将积极寻求其他投资途径和创新的投资方法。

本基金将根据宏观经济形势和行业发展趋势适时调整资产配置比例，从而达到基金资产的长期稳健增值。

本基金通过持有行业分类的沪港通投资股票投资组合。

本基金本期报告期末未持有沪港通投资股票。

5.3 报告期末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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 601300 工商银行 1,370,000 5,169,700 0.04

2 600016 中国银行 215,500 1,029,500 0.04

3 600096 交银内力 115,500 1,517,400 0.05

4 600461 双汇国际 200,211 1,566,582 0.05

5 600303 仰光股份 244,000 1,327,300 0.05

6 600602 华能国际 58,500 1,309,347 0.05

7 601515 金融街 91,100 1,300,900 0.05

8 600187 中信银行 156,000 1,244,370 0.05

9 300145 中环环保 47,000 1,262,360 0.05

10 300223 北新建材 26,000 1,259,040 0.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 国债债券 - -

2 公司债券 - -

3 企业债券 99,976,000.00 12.36

4 政府债券 289,569,861.00 36.69

5 企业短期融资券 110,069,000.00 13.61

6 中期票据 80,691,000.00 0.98

7 可转换(可交换)债 - -

8 同业存单 78,588,000.00 0.72

9 其他 - -

10 合计 667,902,810.00 81.37

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债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 140201 14国开01 800,000 80,098,000.00 0.00

2 1500008 16高西债 700,000 73,787,000.00 0.13

3 011600627 16中行机车 700,000 70,154,000.00 0.06

4 136249 16中行01 700,000 69,601,000.00 0.01

5 112411 16高利01 399,000 39,739,000.00 0.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:1.本基金基金合同生效日为2015年5月4日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间已满一年。

2.本基金建仓期为6个月，从2015年5月4日至2015年11月3日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.4 到期收益率

4.4 期末基金资产净值

5.4.2 基金净值表现

3.2.1 本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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.03% -0.27% 0.30% -0.01% -0.31%

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

沪深300指数收益率(%) 0.00% ±5.00%

本基金成立以来净值增长率或收益=-0.28%，业绩比较基准收益率为-0.31%。

4.4 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本基金本报告期内存在连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人的情形。

5.5 投资组合报告

本基金本报告期内不存在反公平交易制度的执行情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金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没有成交的单边交易盈亏金额未超过万分之三的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.4 报告期内单边投资盈亏金额

本基金本报告期内未投资于反公平交易制度的执行情况。

4.5 报告期内基金投资组合运作分析

本基金本报告期内积极参与新股申购，同时对不同投资组合参与新股申购的比例和获配数量保持一致。

4.6 报告期内基金投资组合运作分析

本基金本报告期内未投资于反公平交易制度的执行情况。

4.7 报告期内基金投资组合运作分析

本基金本报告期内未投资于反公平交易制度的执行情况。

4.8 报告期内基金投资组合运作分析

本基金本报告期内未投资于反公平交易制度的执行情况。

4.9 报告期内基金投资组合运作分析

本基金本报告期内未投资于反公平交易制度的执行情况。

5.6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期初基金份额总额 767,682,536.00

报告期期间内申购总量 21,943,000

报告期期间内赎回总量 164,393,27

报告期末基金份额总额 -

767,050,096.58

5.7 备查文件目录

1.中国证监会批准浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金设立的相关文件；

2.《浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金招募说明书》；

3.《浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金基金合同》；

4.《浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金托管协议》；

5.基金管理人业务资格批件和营业执照；

6.报告期内披露的定期报告披露文件；

7.中国证监会要求的其他文件。

5.8 备查文件

5.9 报告期内基金投资的沪港通投资股票投资组合

5.10 报告期内基金投资的资产支持证券投资组合

5.11 报告期内基金投资的国债投资组合

5.12 报告期内基金投资的资产支持证券组合

5.13 报告期内基金投资的股票投资组合

5.14 报告期内基金投资的债券投资组合

5.15 报告期内基金投资的权证投资组合

5.16 报告期内基金投资的股指期货投资组合

5.17 报告期内基金投资的国债期货投资组合

5.18 报告期内基金投资的资产支持证券投资基金组合

5.19 报告期内基金投资的股票型证券投资基金组合

5.20 报告期内基金投资的债券型证券投资基金组合

5.21 报告期内基金投资的货币型证券投资基金组合

5.22 报告期内基金投资的权证投资基金组合

5.23 报告期内基金投资的股指期货投资基金组合

5.24 报告期内基金投资的国债期货投资基金组合

5.25 报告期内基金投资的资产支持证券投资基金组合

5.26 报告期内基金投资的股票型证券投资基金组合

5.27 报告期内基金投资的债券型证券投资基金组合

5.28 报告期内基金投资的货币型证券投资基金组合

5.29 报告期内基金投资的权证投资基金组合

5.30 报告期内基金投资的股指期货投资基金组合

5.31 报告期内基金投资的国债期货投资基金组合

5.32 报告期内基金投资的资产支持证券投资基金组合

5.33 报告期内基金投资的股票型证券投资基金组合

5.34 报告期内基金投资的债券型证券投资基金组合

5.35 报告期内基金投资的货币型证券投资基金组合

5.36 报告期内基金投资的权证投资基金组合

5.37 报告期内基金投资的股指期货投资基金组合

5.38 报告期内基金投资的国债期货投资基金组合

5.39 报告期内基金投资的资产支持证券投资基金组合

5.40 报告期内基金投资的股票型证券投资基金组合

5.41 报告期内基金投资的债券型证券投资基金组合

5.42 报告期内基金投资的货币型证券投资基金组合

5.43 报告期内基金投资的权证投资基金组合

5.44 报告期内基金投资的股指期货投资基金组合

5.45 报告期内基金投资的国债期货投资基金组合

5.46 报告期内基金投资的资产支持证券投资基金组合

5.47 报告期内基金投资的股票型证券投资基金组合

5.48 报告期内基金投资的债券型证券投资基金组合

5.49 报告期内基金投资的货币型证券投资基金组合

5.50 报告期内基金投资的权证投资基金组合