

浙商沪深300指数分级证券投资基金

[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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2017年1月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、基金资产组合报告等内容，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。

本报告是财务资料未经审计。

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

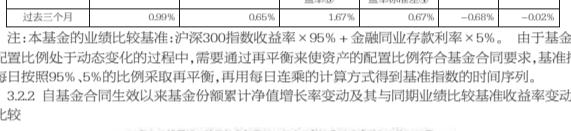
基金简称	浙商沪深300指数分级		
场内简称	浙商300		
交易代码	166882		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年1月20日		
报告期末基金份额总额	2,231,222,000份		
投资目标	本基金采取量化操作方式，通过严格的择时操作的和积极做多的的风险管理手段，追求对市场的有效投资，同时将操作的和积极做多的积极投资结合起来，以期获得良好的其他收益。		
投资策略	本基金采取量化操作方式，按照量化选股的和积极做多的的风险管理手段，追求对市场的有效投资，同时将操作的和积极做多的积极投资结合起来，以期获得良好的其他收益。		
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+金融衍生品收益×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，股票型基金具有与股票相关的市场风险特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和现金型基金，风险收益大于混合型基金，具有较高的预期风险和预期收益。		
基金管理人	浙商基金管理有限公司		
基金托管人	华夏银行股份有限公司		
下属分级基金简称	浙商稳健	浙商进取	浙商沪深300指数分级
下属分级基金交易代码	150076	150077	169892
下属分级基金报告期末基金份额总额	2,231,222,000份	2,231,223,000份	10,066,900,177份
总额			96.02
下属分级基金的收益特征	浙商稳健:浙商稳健类具有较低风险,收益相对较低;浙商进取:浙商进取类具有较高风险,预期收益相对较高;浙商沪深300指数分级类具有中等风险,预期收益相对中等风险,预期收益相对较低。		

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标		
报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)		单位:人民币元
1.本期已实现收益	-946,156.14	
2.本期利润	1,626,243.44	0.036%
3.加权平均基金份额本期利润	0.0086	
4.期末基金份额净值	25,406,312.21	
5.期末基金资产净值	1,127	

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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:1、本基金合同生效日为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6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(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
查晓晓	本基金的基金经理	2016年1月11日	-	6

查晓晓,香港中文大学财务管理学士、历史学学士,现任职于浙商基金管理有限公司投资策略与研究部分析师。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金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、证监会规定及基金合同的约定,诚实守信、勤勉尽责地原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金组合投资符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平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,本公司制定了公平的公平交易制度。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;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,本公司基金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。

报告期内,本基金未发生违反公平交易制度的行为。

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单边成交量5%的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金通过投资的股票和债券,按照基金合同的要求,使用定量分析等技术,分析和应对导致基金跟踪误差的因素,积极应对市场的剧烈变化,努力将基金的跟踪误差控制在较低水平,实现基金约定的投资策略,达到相应回报。本基金坚持持续优化指数跟踪策略,针对基金规模小、申购赎回对净值波动影响的情况,努力做了应对,较好地完成了跟踪目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日止,报告期内本基金份额净值增长率为0.09%,业绩比较基准收益率为1.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

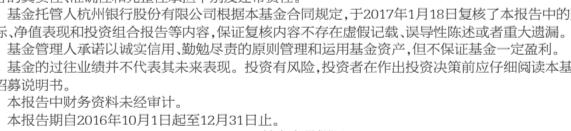
本基金报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浙商沪深300指数分级
交易代码	002900
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月20日
报告期末基金份额总额	3,476,902,400.00份
投资目标	在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用量化操作方式,通过严格的择时操作的和积极做多的的风险管理手段,追求对市场的有效投资,同时将操作的和积极做多的积极投资结合起来,以期获得良好的其他收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+金融衍生品收益×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,股票型基金具有与股票相关的市场风险特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和现金型基金,风险收益大于混合型基金,具有较高的预期风险和预期收益。
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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:本基金合同生效日为2012年6月20日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间已满一年。

2、本基金建仓期为6个月,从2012年6月20日至2012年11月6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(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
吕文萍	本基金的基金经理	2016年6月20日	-	6

吕文萍,香港中文大学财务管理学士、历史学学士,现任职于浙商基金管理有限公司投资策略与研究部分析师。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金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、证监会规定及基金合同的约定,诚实守信、勤勉尽责地原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金组合投资符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平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,本公司制定了公平的公平交易制度。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;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,本公司基金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。

报告期内,本基金未发生违反公平交易制度的行为。

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单边成交量5%的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金通过投资的股票和债券,按照基金合同的要求,使用定量分析等技术,分析和应对导致基金跟踪误差的因素,积极应对市场的剧烈变化,努力将基金的跟踪误差控制在较低水平,实现基金约定的投资策略,达到相应回报。本基金坚持持续优化指数跟踪策略,针对基金规模小、申购赎回对净值波动影响的情况,努力做了应对,较好地完成了跟踪目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日止,报告期内本基金份额净值增长率为-0.87%,业绩比较基准收益率为-2.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

本基金报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浙商沪深300指数分级
交易代码	002900
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月20日
报告期末基金份额总额	3,476,902,400.00份
投资目标	在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+金融衍生品收益×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,股票型基金具有与股票相关的市场风险特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和现金型基金,风险收益大于混合型基金,具有较高的预期风险和预期收益。
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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:本基金合同生效日为2012年6月20日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间已满一年。

2、本基金建仓期为6个月,从2012年6月20日至2012年11月6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(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
吕文萍	本基金的基金经理	2016年6月20日	-	6

吕文萍,香港中文大学财务管理学士、历史学学士,现任职于浙商基金管理有限公司投资策略与研究部分析师。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金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、证监会规定及基金合同的约定,诚实守信、勤勉尽责地原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金组合投资符合有关法规及基金合同的约定。