

# 浙商惠享纯债债券型证券投资基金

## 2017年第三季度报告

本报告期内,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 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内本基金主要投资品种为利率债和信用债。信用债以中高评级的短融中票、公司债、同业存单等为主,利率债以中短期国债、政策性银行债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.0039元;本报告期基金份额净值增长率为0.88%,业绩比较基准收益率为-0.42%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明  
本基金本报告期内存在连续二十个工作日基金持有人数少于低于两百万的情形。

本基金本报告期末未持有股票。

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	692,363,000.00	97.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,764,364,000.00	43.38
4	其中:政策性金融债	1,247,117,000.00	30.66
5	企业债券	433,369,000.00	10.66
6	企业短期融资券	50,223,000.00	1.24
7	中期票据	-	-
8	可转债(可交换债)	191,910,000.00	4.72
9	其他	-	-
10	合计	3,122,009,000.00	77.01

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	110017	17国债01	8,400,000	540,970,000.00	13.30
2	170409	17财国债09	2,500,000	248,370,000.00	6.11
3	170304	17财国债04	2,500,000	247,490,000.00	6.08
4	160205	16国债05	2,000,000	190,210,000.00	4.72
5	160203	16国债03	2,000,000	194,180,000.00	4.82

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	178920	17康盛AA2	3,000,000	300,390,000.00	7.39
2	125249	14广信A	2,000,000	201,510,000.00	4.99
3	178956	17广信AA2	1,000,000	100,210,000.00	2.48
4	131770	13南信A	960,000	94,810,000.00	2.33
5	178946	17广信AA1	800,000	82,410,000.00	2.04
6	123500	康隆AA1	320,000	32,110,000.00	0.79
7	116268	康隆07	136,000	13,410,000.00	0.34
8	116677	康隆08	184,000	18,220,000.00	0.45
9	116676	康隆06	178,000	17,360,000.00	0.43

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
5.9.1 本期国债期货投资政策  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
5.9.3 本期国债期货投资评价  
本基金本报告期末未投资国债期货。

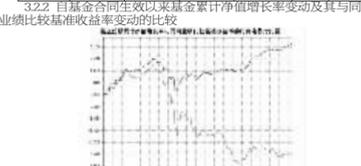
5.10 投资组合报告附注  
1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
2. 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。  
5.10.3 其他资产构成

主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年9月30日)
1.本期累计收益总额	21,961,407.24
2.本期利润	39,770,372.63
3.本期公允价值变动损益	0.00
4.本期基金费用	4,006,956,296.38
5.本期基金份额净值	1.0039

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变动的比较

阶段	净值增长率(%)	净值增长率波动率(%)	业绩比较基准收益(%)	业绩比较基准波动率(%)	1-3	2-6
过去三个月	0.88%	0.62%	-0.42%	0.60%	1.30%	-0.01%



注:1.本基金基金合同生效日为2016年6月20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2016年6月20日至2016年12月19日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
吕文杰	本基金的基金经理	2016年6月20日	6	吕文杰先生,国籍中国,毕业于上海交通大学,曾任交通银行总行资产管理部副经理,从事银行资产管理业务,具有多年证券从业经历,具备基金从业资格。
曹晓程	本基金的基金经理	2017年2月17日	6	曹晓程先生,籍贯中国,毕业于上海交通大学,曾任交通银行总行资产管理部副经理,从事银行资产管理业务,具有多年证券从业经历,具备基金从业资格。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
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,证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本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 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》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《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间日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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内本基金主要投资品种为利率债和信用债。信用债以中高评级的中票、城投债等为主,利率债以中短期国债、政策性银行债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.0039元;本报告期基金份额净值增长率为0.88%,业绩比较基准收益率为-0.42%。

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。

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
5.9.1 本期国债期货投资政策  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
5.9.3 本期国债期货投资评价  
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注  
1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
2. 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。  
5.10.3 其他资产构成

# 浙商惠裕纯债债券型证券投资基金

## 2017年第三季度报告

本报告期内,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 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内本基金主要投资品种为利率债和信用债。信用债以中高评级的中票、城投债等为主,利率债以中短期国债、政策性银行债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.0092元;本报告期基金份额净值增长率为0.33%,业绩比较基准收益率为-0.42%。

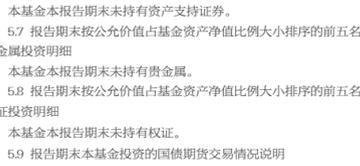
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明  
本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年9月30日)
1.本期累计收益总额	17,946,722.41
2.本期利润	4,799,693.13
3.本期公允价值变动损益	0.00
4.本期基金费用	1,406,076,000.00
5.本期基金份额净值	0.9992

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变动的比较

阶段	净值增长率(%)	净值增长率波动率(%)	业绩比较基准收益(%)	业绩比较基准波动率(%)	1-3	2-6
过去三个月	0.33%	0.65%	-0.42%	0.60%	0.75%	-0.01%



注:1.本基金基金合同生效日为2016年11月7日,基金合同生效日至本报告期末,本基金生效时间未满足一年。  
2.本基金建仓期为6个月,从2016年11月7日至2017年5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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
吕文杰	本基金的基金经理	2016年11月7日	6	吕文杰先生,国籍中国,毕业于上海交通大学,曾任交通银行总行资产管理部副经理,从事银行资产管理业务,具有多年证券从业经历,具备基金从业资格。
曹晓程	本基金的基金经理	2017年9月18日	6	曹晓程先生,籍贯中国,毕业于上海交通大学,曾任交通银行总行资产管理部副经理,从事银行资产管理业务,具有多年证券从业经历,具备基金从业资格。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
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,证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本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 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》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《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间日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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内本基金主要投资品种为利率债和信用债。信用债以中高评级的中票、城投债等为主,利率债以中短期国债、政策性银行债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.0092元;本报告期基金份额净值增长率为0.33%,业绩比较基准收益率为-0.42%。

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。

# 浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金

## 2017年第三季度报告

本报告期内,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 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内本基金主要投资品种为利率债和信用债。信用债以中高评级的中票、城投债等为主,利率债以中短期国债、政策性银行债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末本基金份额净值为0.9802元;本报告期基金份额净值增长率为0.33%,业绩比较基准收益率为-0.42%。

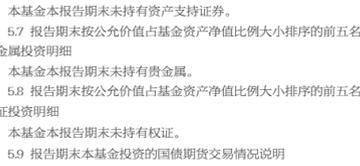
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明  
本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年9月30日)
1.本期累计收益总额	17,946,722.41
2.本期利润	4,799,693.13
3.本期公允价值变动损益	0.00
4.本期基金费用	1,406,076,000.00
5.本期基金份额净值	0.9992

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变动的比较

阶段	净值增长率(%)	净值增长率波动率(%)	业绩比较基准收益(%)	业绩比较基准波动率(%)	1-3	2-6
过去三个月	0.33%	0.65%	-0.42%	0.60%	0.75%	-0.01%



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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
曹晓程	本基金的基金经理	2016年3月17日	6	曹晓程先生,国籍中国,毕业于上海交通大学,曾任交通银行总行资产管理部副经理,从事银行资产管理业务,具有多年证券从业经历,具备基金从业资格。
吕文杰	本基金的基金经理	2016年3月17日	6	吕文杰先生,国籍中国,毕业于上海交通大学,曾任交通银行总行资产管理部副经理,从事银行资产管理业务,具有多年证券从业经历,具备基金从业资格。
曹晓程	本基金的基金经理	2017年9月17日	6	曹晓程先生,籍贯中国,毕业于上海交通大学,曾任交通银行总行资产管理部副经理,从事银行资产管理业务,具有多年证券从业经历,具备基金从业资格。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
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,证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本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 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》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《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间日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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内本基金主要投资品种为利率债和信用债。信用债以中高评级的中票、城投债等为主,利率债以中短期国债、政策性银行债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末本基金份额净值为0.9802元;本报告期基金份额净值增长率为0.33%,业绩比较基准收益率为-0.42%。

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。

# 浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金

## 2017年第三季度报告

本报告期内,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 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内本基金主要投资品种为利率债和信用债。信用债以中高评级的中票、城投债等为主,利率债以中短期国债、政策性银行债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末本基金份额净值为0.9802元;本报告期基金份额净值增长率为0.33%,业绩比较基准收益率为-0.42%。

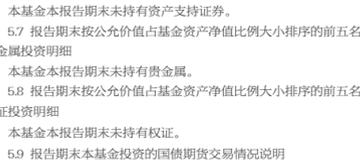
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明  
本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年9月30日)
1.本期累计收益总额	121,692.26
2.本期利润	2,130,026.29
3.本期公允价值变动损益	0.00
4.本期基金费用	11,209,397.55
5.本期基金份额净值	1.01

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变动的比较

阶段	净值增长率(%)	净值增长率波动率(%)	业绩比较基准收益(%)	业绩比较基准波动率(%)	1-3	2-6
过去三个月	5.24%	0.62%	2.24%	0.59%	3.00%	0.26%



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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
曹晓程	本基金的基金经理	2016年3月17日	6	曹晓程先生,国籍中国,毕业于上海交通大学,曾任交通银行总行资产管理部副经理,从事银行资产管理业务,具有多年证券从业经历,具备基金从业资格。
吕文杰	本基金的基金经理	2016年3月17日	6	吕文杰先生,国籍中国,毕业于上海交通大学,曾任交通银行总行资产管理部副经理,从事银行资产管理业务,具有多年证券从业经历,具备基金从业资格。
曹晓程	本基金的基金经理	2017年9月17日	6	曹晓程先生,籍贯中国,毕业于上海交通大学,曾任交通银行总行资产管理部副经理,从事银行资产管理业务,具有多年证券从业经历,具备基金从业资格。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
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,证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本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 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》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《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间日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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内本基金主要投资品种为利率债和信用债。信用债以中高评级的中票、城投债等为主,利率债以中短期国债、政策性银行债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末本基金份额净值为0.9802元;本报告期基金份额净值增长率为0.33%,业绩比较基准收益率为-0.42%。

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。

报告期内的基金投资组合

序号	证券名称	金额(元)
1	应付债券	107,470.03
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	63,786,179.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	预收款项	11,163.21
8	其他	-
9	合计	63,903,809.86

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。  
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末未持有股票。  
5.10.6 报告期末报告附注的其他文字描述部分  
因四舍五入的原因,投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。  
§ 6 开放式基金份额变动

报告期内的基金份额变动

项目	基金份额(份)
报告期内的基金份额总额	4,061,209,202.43
报告期内的基金份额总额	4,061,209,202.43
减:报告期内的基金份额总额	5,438.02
报告期内的基金份额总额	4,061,203,764.41

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息