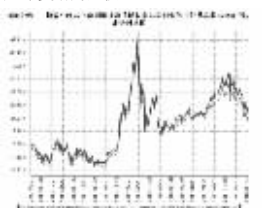


# 浙商沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

## 2018年第三季度报告

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



注：1、本基金基金合同生效日为2012年6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6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（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
查晓磊	本基金基金经理、基金经理助理、公司投资决策部总经理	2015年8月11日	-	7

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
查晓磊	本基金基金经理、基金经理助理、公司投资决策部总经理	2015年8月20日	-	7

#### 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，在严格控制投资组合风险的基础上，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，对不同投资组合在不同时间公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和反向交易的交易时机进行监控，同时对不同投资组合的临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机交易价差进行分析。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

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

本基金在报告期内完成产品类属转换，变更为沪深300指数增强基金。本基金通过投资约束和数量化控制，按照基金合同约定的要求，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下，实现增强策略，达到产生相对基准超额收益的投资目的。报告期内，本基金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大的情况，尽力做了对应，较好的完成了跟踪目标。  
宏观经济下行压力开始在数据上显现，投资、消费和进出口均有不同程度的隐忧。同时，在油价、猪肉、天气、贸易等因素影响下的通胀预期开始升温。政策层面的对冲也在逐步显现，稳定市场预期和信心的措施陆续出现。在目前经济开始下行，通胀预期上升，伴随政策开始发力的时间窗口中，预期往往反而是紊乱的，表现在市场上就是大幅的波动。国内的环境变化和中美之间的摩擦，更加增加了这种不确定性。

从当前估值比较看，A股整体估值水平处于较低状态，相比于中长期信用债收益率的风险溢价位于90%位数，中长期吸引力已经十分明显。

#### 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1.1710元；本基金转型前份额净值增长率为-6.72%，业绩比较基准收益率为-7.61%；本基金转型后份额净值增长率为5.4%，业绩比较基准收益率为6.16%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金存在连续六十个工作日基金资产净值少于5000万元的情形，基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案，并与2018年8月20日转型。

### 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产比例（%）
1	权益投资	21,515,364.93	93.61
2	其中：股票	21,515,364.93	93.61
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	其他资产	1,493,183.09	6.31
8	其他负债	68,088.98	0.29
9	合计	22,566,477.01	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	477,412.96	2.11
C	制造业	9,076,722.07	80.04
D	电力、热力、燃气及生产供应业	697,000.00	2.94
E	建筑业	720,366.00	3.23
F	批发和零售业	223,990.32	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	620,502.00	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	389,302.66	1.68
J	金融业	7,327,701.11	64.00
K	房地产业	1,066,400.00	4.60
L	租赁和商务服务业	620,720.00	2.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	266,520.00	1.13
S	综合	-	-
合计		31,440,043.10	94.60

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	477,412.96	0.01
C	制造业	68,479,300	0.30
D	电力、热力、燃气及生产供应和公用事业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		70,391,713	0.31

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应和公用事业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		30,377,355.08	96.88

#### 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	601318	中国平安	17,228	1,180,110.00	1.21
2	600008	首创股份	36,494	1,120,000.00	1.24
3	601306	华新股份	18,216	919,543.00	1.00
4	601106	兴发集团	43,549	894,000.00	1.00
5	601004	上汽集团	20,717	689,461.36	0.74
6	600022	招商局	12,749	670,760.00	0.74
7	600066	五粮液	9,516	646,012.00	0.70
8	600519	贵州茅台	877	640,210.00	0.70
9	600061	格力电器	15,540	626,310.00	0.70
10	600016	民生银行	68,088	626,062.00	0.70

#### 5.3.1 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债券投资明细

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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31
2	601118	海南橡胶	397	2,032.34	0.01

#### 5.3.2 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	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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31
2	601118	海南橡胶	397	2,032.34	0.01

#### 5.3.3 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贵金属投资明细

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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31
2	601118	海南橡胶	397	2,032.34	0.01

#### 5.3.4 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权证投资明细

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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31
2	601118	海南橡胶	397	2,032.34	0.01

#### 5.3.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资明细

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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31
2	601118	海南橡胶	397	2,032.34	0.01

## 2018年第三季度报告

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。信用债以中高级别的短融中票、企业债等为主，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1.0565元；本报告期基金份额净值增长率为1.48%，业绩比较基准收益率为0.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明  
本报告期内本基金存在连续二十个工作日持有人数低于200人的情形。

### 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产比例（%）
1	权益投资	-	-
2	其中：股票	-	-
3	固定收益投资	264,388,000.00	96.61
4	其中：债券	264,388,000.00	96.61
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	其他资产	2,690,748.72	1.34
8	其他负债	32,409,754.64	10.00
9	合计	267,008,743.36	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		264,388,000.00	100.00

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应和公用事业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		264,388,000.00	100.00

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应和公用事业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		264,388,000.00	100.00

#### 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债券投资明细

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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31
2	601118	海南橡胶	397	2,032.34	0.01

#### 5.3.1 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	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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31
2	601118	海南橡胶	397	2,032.34	0.01

#### 5.3.2 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贵金属投资明细

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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31
2	601118	海南橡胶	397	2,032.34	0.01

#### 5.3.3 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权证投资明细

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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31
2	601118	海南橡胶	397	2,032.34	0.01

#### 5.3.4 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指期货投资明细

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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31
2	601118	海南橡胶	397	2,032.34	0.01

#### 5.3.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资明细

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	600486	中国铁建	4,721	68,879.30	0.31