浙商聚潮新思维混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

基金管理人:浙商基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2016年3月25日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浙商聚潮新思维混合
基金主代码	166801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月8日
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	76,143,064.82

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘运用经济发展新思维与社会发展新思维实现可持续发展的上市公司的投资机会,在科学管理风险的前提下,追求基金资产的中长期持续稳定增值。
投资策略	本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投资策略,主要通过资产配置策略与股票选择策略,优选运用新思维实现可持续发展的上市公司股票,在科学管理风险的前提下构建投资组合,以充分分享中国可持续发展的经济成果,实现组合资产中长期持续稳定增值的投资目标。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为主动投资的混合型基金,其预期风险和收益高于债券型基金、货币市场基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浙商基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	罗菲菲
	联系电话	021-60350812	010-58560666
	电子邮箱	guoleqi@zsfund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	95568
传真		0571-28191919	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	34,179,768.76	21,231,473.06	54,968,484.57
本期利润	38,645,848.18	23,786,035.75	24,481,110.35
加权平均基金份额本期利润	0.8212	0.4826	0.1899
本期加权平均净值利润率	36.86%	37.00%	17.45%
本期基金份额净值增长率	47.04%	45.72%	16.86%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	118,304,146.46	28,142,147.02	12,440,624.50
期末可供分配基金份额利润	1.5537	0.7368	0.1920
期末基金资产净值	194,447,211.28	66,338,474.78	77,227,218.47
期末基金份额净值	2.554	1.737	1.192
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	155.40%	73.70%	19.20%

3.2 基金净值表现

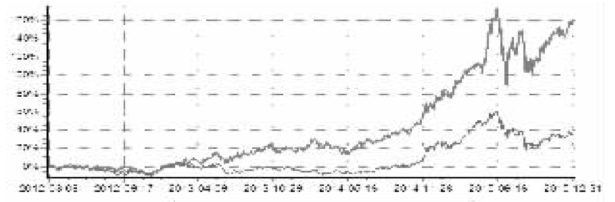
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.70%	1.28%	9.92%	0.92%	7.78%	0.36%
过去六个月	10.28%	2.33%	-7.13%	1.47%	17.41%	0.86%
过去一年	47.04%	2.06%	7.82%	1.37%	39.22%	0.69%
过去三年	150.39%	1.49%	35.33%	0.98%	115.06%	0.51%
自基金合同生效日起至今(2012年03月08日-2015年12月31日)	155.40%	1.37%	35.15%	0.92%	120.25%	0.45%

注:本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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55%、45%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序列。

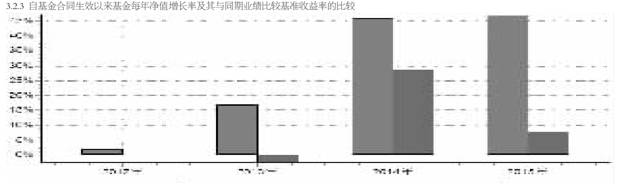
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同生效日为2012年3月8日,基金合同生效日至本报告期期末,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3月8日至2012年9月7日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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2012年实际运作期间为2012年3月8日(基金合同生效日)至2012年12月31日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

基金自2012年3月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浙商基金管理有限公司(简称"浙商基金")经中国证券监督管理委员会(证监许可[2010]1312号)批准,于2010年10月21日成立。公司股东为浙商证券股份有限公司、通联资本管理有限公司、养生堂有限公司、浙江浙大网新集团有限公司,四家股东各出资7500万元,公司注册资本3亿元人民币。注册地为浙江省杭州市。

截至2015年12月31日,浙商基金共管理七只开放式基金--浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、浙商沪深300指数分级证券投资基金、浙商聚盈信用债债券型证券投资基金、浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金、浙商日添利货币市场基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张文洁	本基金的基金经理	2012年12月31日	2015年4月3日	10	张文洁女士,上海社会科学院产业经济学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司证券研究所通信行业研究员,长信基金管理有限责任公司研究员。
倪权生	本基金的基金经理,公司股票投资部副总经理	2015年3月30日	-	5	倪权生先生,上海交通大学金融学博士。历任博时基金管理有限公司研究部研究员、高级研究员。
莫华寅	本基金的基金经理	2015年4月3日	2015年8月14日	8	莫华寅先生,CFA,上海外国语大学工商管理硕士。历任中银基金销售与市场部华南区总经理,东吴证券固定收益部高级交易员。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《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和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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同日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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年,全球经济整体难言复苏,除了少数发达经济区采取强力的量化宽松计划使得经济出现一定的复苏迹象外,多数新兴国家因经济基础相对薄弱,且受到资产价格波动和资本流出的影响,经济状况不容乐观。由于经济持续不景气,特别是中国的经济增速继续下行,导致能源及原材料需求下滑,几乎所有大宗商品价格出现大幅跳水。

2015年中国经济总体下行,从第一季度的7%温和回调至第四季度的6.8%,全年经济增长6.9%,实现了"7%左右"的年度增长预期目标。三大产业增速均下滑,第二产业增速下滑幅度最大,第三产业(尤其金融业和房地产业)对GDP的贡献率明显增加。固定资产投资持续回落,消费增长平稳,消费对经济增长贡献率稳定提高。

2015年全年上证综指上涨11.79%,深证成指上涨18.12%。期间股市经历了大幅波动,上半年上证综指上涨35.11%,其中年初至6月中旬高点上涨63.19%,深证成指上半年上涨33.72%,其中年初至6月中旬高点上涨68.79%。6月中旬后经历股灾,股票出现大面积跳水,股指回落。

2015年,浙商聚潮新思维选股主要基于自下而上的思路,在大多数行业向上趋势不显著的背景下,精挑个股。年初股票配置的非银金融行业个股、金融类股票、地产类股票和医药类股票。年中配置逐步转向消费、农业、化工、医药等领域,随着上半年估值的上升,下半年逐渐配置转向金融、地产、汽车等估值较低的领域。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为2.554元,报告期内净值增长率为47.04%,业绩比较基准收益率为7.82%,沪深300指数收益率为5.58%,基金净值增长率超越业绩比较基准收益率39.22%,超越沪深300指数收益率41.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面,总需求乏力而资本存量大幅积累,对实体经济的资本回报率无法形成过高预期,投资率下降,去产能还需等待。经济增长在中枢下降与政策托底之间缺乏弹性,结构性问题重于周期性问题。

货币政策方面,政策整体基调继续中性,货币环境不会太紧,但边际上变松的空间弱于2015年。地方债置换继续推进,进而推升货币活化程度,可能会降低降准的频率和概率。资金通过金融工具和金融创新进入资本市场,将会引起监管部门的重视,加大市场波动幅度。

财政政策方面,阶段性提高赤字率,扩大赤字规模,相应增加国债发行规模。政策将以基建为抓手,带动基建投资继续承担托底经济的角色。我们观察到企业拿地积极性开始上升,房地产及此后的制造业投资将可能低位企稳,由此带动整个经济增速下滑的态势趋于稳定。

汇率问题,今后人民币汇率的重心将从盯美元转向盯一篮子货币,长期看,中国在全球的相对生产率和竞争力是汇率的最终保障底线,中短期看,利率是重心,汇率是结果,两个稳定--国内利率水平及和外金融净头寸,是汇率稳定的重要前提。

我们认为蕴藏机遇的行业包括农业(养殖)、医药研发、医疗美容、体育用品、云计算(SaaS)、养老产业、高端制造及一部分转型的重组公司;我们认为存在风险收益不匹配的领域包括传媒、计算机以及靠收购实现增长且市值大于200亿的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值,本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作的估值委员会,并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允与合理。公司估值委员会成员中不包括基金经理。报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期内未进行收益分配。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对浙商聚潮新思维混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金管理人—浙商基金管理有限公司在浙商聚潮新思维混合型证券投资基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,浙商聚潮新思维混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由浙商聚潮新思维混合型证券投资基金管理人—浙商基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第1600412号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浙商聚潮新思维混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的第1页至第30页的浙商聚潮新思维混合型证券投资基金(以下简称"浙商聚潮新思维基金")财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是浙商聚潮新思维基金管理人浙商基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价浙商基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,浙商聚潮新思维基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了浙商聚潮新思维基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果及基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	王国蓓 水青
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市南京西路1266号恒隆广场50楼
审计报告日期	2016-03-24

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:浙商聚潮新思维混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	60,632,966.66	10,869,517.66
结算备付金		242,947.10	841,522.41
存出保证金		62,568.49	206,026.19
交易性金融资产	7.4.7.2	133,948,296.26	54,783,364.17
其中:股票投资		133,948,296.26	45,891,930.27
基金投资		-	-
债券投资		-	8,891,433.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,029,498.53
应收利息	7.4.7.5	17,800.12	34,904.45
应收股利		-	-
应收申购款		63,196.55	4,099.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		194,967,775.18	68,768,933.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,333,563.12
应付赎回款		30,530.08	118,035.43
应付管理人报酬		178,241.79	82,834.28
应付托管费		29,706.96	13,805.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	126,364.72	406,606.75
应交税费		25,605.30	25,605.30
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	130,115.05	450,007.84
负债合计		520,563.90	2,430,458.44
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	76,143,064.82	38,196,327.76
未分配利润	7.4.7.10	118,304,146.46	28,142,147.02
所有者权益合计		194,447,211.28	66,338,474.78
负债和所有者权益总计		194,967,775.18	68,768,933.22

注:①报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.554元,基金份额总额76143064.82份。

7.2 利润表

会计主体:浙商聚潮新思维混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		41,773,190.08	26,984,206.47
1.利息收入		464,091.46	550,254.38
其中:存款利息收入	7.4.7.11	272,418.38	91,401.48
债券利息收入		133,156.01	367,295.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		58,517.07	91,557.80
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		36,633,559.36	23,869,191.40
其中:股票投资收益	7.4.7.12	35,576,565.19	19,847,308.14
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	549,774.79	3,600,836.11
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	507,219.38	421,047.15
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	4,466,079.42	2,554,562.69
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	209,459.84	10,198.00
减:二、费用		3,127,341.90	3,198,170.72
1.管理人报酬		1,564,667.05	966,590.81
2.托管费		260,777.93	161,098.56
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	1,137,956.49	1,628,353.34
5.利息支出		1,650.43	53,949.01
其中:卖出回购金融资产支出		1,650.43	53,949.01
6.其他费用	7.4.7.20	162,290.00	388,179.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		38,645,848.18	23,786,035.75
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		38,645,848.18	23,786,035.75

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浙商聚潮新思维混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	38,196,327.76	28,142,147.02	66,338,474.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,645,848.18	38,645,848.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	37,946,737.06	51,516,151.26	89,462,888.32
其中:1.基金申购款	135,004,463.47	165,730,811.05	300,735,274.52
2.基金赎回款	-97,057,726.41	-114,214,659.79	-211,272,386.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	76,143,064.82	118,304,146.46	194,447,211.28

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	64,786,593.97	12,440,624.50	77,227,218.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,786,035.75	23,786,035.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-26,590,266.21	-8,084,513.23	-34,674,779.44
其中:1.基金申购款	3,042,013.53	1,239,971.41	4,281,984.94
2.基金赎回款	-29,632,279.74	-9,324,484.64	-38,956,764.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	38,196,327.76	28,142,147.02	66,338,474.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

李志惠 基金管理人负责人	唐生林 主管会计工作负责人	唐生林 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浙商聚潮新思维混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于核准浙商聚潮新思维混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]2041号文)批准,由浙商基金管理有限公司(以下简称"浙商基金公司")依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《浙商聚潮新思维混合型证券投资基金基金合同》于2012年2月6日至2012年3月5日公开发售,募集资金总额人民币784,917,869.79元,其中扣除认购费后的有效认购资金人民币784,601,312.72元,有效认购资金在募集期间产生利息人民币316,557.07元,共折合784,917,869.79份基金份额。上述募集资金已经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了KPMG-B (2012) CR No.0010号验资报告。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为浙商基金公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称"民生银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《浙商聚潮新思维混合型证券投资基金基金合同》和《浙商聚潮新思维混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的比例范围为:股票资产占基金资产的比例范围为30%-80%,其中投资于受益于新思维理念的行业或公司的比例不低于股票资产的80%,债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例范围为20%-70%,其中基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,扣除股指期货保证金以后基金保留的现金或到期日在1年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的股票投资部分的业绩比较基准为沪深300指数收益率,债券投资部分为上证国债指数收益率,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况、2015年度的经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注7.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

人民币

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量,公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时,本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的,本基金将下列两项金额的差额计入当期损益:

—所转移金融资产的账面价值

—因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时,考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等),并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,没有相互抵销。但是,同时满足下列条件的,以相互抵销后的净额在资产负债表内列示:

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的;
- 本基金计划以净额结算,或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时,申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益,包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量,并于年末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《浙商聚潮新思维混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金每份基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%;若基金合同生效不满3个月,可不进行收益分配。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称"估值处理标准"),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据估值处理标准,本基金自2015年3月30日起,对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。于2015年3月30日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号文《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2015年9月8日及以后的,暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浙商基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
浙商证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
通联资本管理有限公司	基金管理人的股东
浙江浙大网新集团有限公司	基金管理人的股东
养生堂有限公司	基金管理人的股东
上海聚潮资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
浙商证券	134,994,608.73	17.87%	64,158,368.98	6.03%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
浙商证券	28,426,099.58	27.66%	42,645,363.40	20.83%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
浙商证券	5,000,000.00	11.74%	54,700,000.00	18.62%

注:本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
浙商证券	123,522.60	17.56%	18,428.16	14.64%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
浙商证券	58,409.85	6.03%	44,012.98	10.82%

注:上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券交易单元租用协议》,本基金管理人在租用浙商证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时,还从浙商证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,564,667.05	966,590.81
其中:支付销售机构的客户维护费	411,387.33	386,560.00

注:支付基金管理人浙商基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	260,777.93	161,098.56

注:支付基金托管人民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金没有销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本年度与上年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本年度与上年度均未持有过本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	60,632,966.66	255,931.81	10,869,517.66	78,550.30

注:本基金通过"民生银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于2015年12月31日的相关余额为人民币242,947.10元。(2014年12月31日:人民币841,522.41元)

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

7.4.9 利润分配情况

7.4.9.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金在本年度未进行过利润分配。(2014年:零)

7.4.10 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法》,证券投资基金参与网下配售,可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

于2015年12月31日,本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2015年12月31日,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

于2015年12月31日,本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期期末2015年12月31日,本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	133,948,296.26	68.70
	其中:股票	133,948,296.26	68.70
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	60,875,913.76	31.22
7	其他各项资产	143,565.16	0.07
8	合计	194,967,775.18	100.00

注:由于位数保留及尾差问题,本报告期末各基金资产占基金总资产的比例合计可能不等于1。

8.2 报告期末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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	97,021,396.85	49.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,504,105.28	3.86
F	批发和零售业	17,398,367.66	8.95
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	7,160,070.00	3.68
K	房地产业	2,247,705.00	1.16
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	3,751.47	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,612,900.00	1.34
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	133,948,296.26	68.89

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600976	健民集团	334,858	11,328,246.14	5.83
2	300006	莱美药业	251,300	10,052,000.00	5.17
3	002370	亚太药业	271,734	9,627,535.62	4.95
4	002563	森马服饰	629,666	7,807,858.40	4.02
5	002100	天康生物	768,300	7,729,098.00	3.97
6	600529	山东药玻	395,700	7,648,881.00	3.93
7	002051	中工国际	295,516	7,485,420.28	3.85
8	002035	华帝股份	411,400	7,314,692.00	3.76
9	000963	华东医药	74,062	6,070,121.52	3.12
10	000625	长安汽车	341,900	5,802,043.00	2.98
11	000001	平安银行	483,000	5,791,170.00	2.98
12	600276	恒瑞医药	106,100	5,211,632.00	2.68
13	600066	宇通客车	229,000	5,150,210.00	2.65
14	000639	西王食品	285,691	4,833,891.72	2.49
15	300040	九洲电气	286,500	3,899,265.00	2.01
16	600385	山东金泰	140,100	3,841,542.00	1.98
17	000017	深中华A	272,000	3,780,800.00	1.94
18	002250	联化科技	190,000	3,585,300.00	1.84
19	300196	长海股份	100,600	3,580,354.00	1.84
20	002311	海大集团	237,463	3,317,358.11	1.71
21	300347	泰格医药	85,000	2,612,900.00	1.34
22	300261	雅本化学	154,400	2,331,440.00	1.20
23	000046	泛海控股	179,100	2,247,705.00	1.16
24	000587	金叶珠宝	70,400	1,496,000.00	0.77
25	601169	北京银行	130,000	1,368,900.00	0.70
26	002781	奇信股份	500	18,685.00	0.01
27	002782	可立克	500	10,635.00	0.01
28	600593	大连圣亚	73	3,751.47	-
29	601616	广电电气	100	861.00	-

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002100	天康生物	12,337,393.64	18.60
2	600976	健民集团	11,568,517.40	17.44
3	300327	中颖电子	11,335,705.90	17.09
4	000001	平安银行	10,316,650.06	15.55
5	000639	西王食品	10,160,383.60	15.32
6	002563	森马服饰	9,544,994.00	14.39
7	002370	亚太药业	9,402,705.84	14.17
8	300006	莱美药业	8,192,997.88	12.35
9	002051	中工国际	8,005,102.62	12.07
10	600529	山东药玻	7,659,915.00	11.55
11	600588	用友网络	6,998,845.01	10.55
12	002035	华帝股份	6,457,450.00	9.73
13	600593	大连圣亚	6,318,718.54	9.52
14	000712	锦龙股份	5,716,504.99	8.62
15	000625	长安汽车	5,605,093.00	8.45
16	002311	海大集团	5,511,715.00	8.31
17	000963	华东医药	5,408,837.60	8.15
18	300218	安利股份	5,323,760.04	8.03
19	600066	宇通客车	5,106,479.00	7.70
20	002250	联化科技	5,027,747.92	7.58
21	601318	中国平安	4,905,069.51	7.39
22	600276	恒瑞医药	4,567,082.05	6.88
23	000858	五 粮 液	4,514,214.76	6.80
24	600109	国金证券	4,472,406.48	6.74
25	300059	东方财富	4,365,442.00	6.58
26	600211	西藏药业	4,131,161.12	6.23
27	000895	双汇发展	4,112,447.00	6.20
28	000017	深中华A	4,110,183.68	6.20
29	002766	索菱股份	3,904,597.01	5.89
30	601633	长城汽车	3,882,870.96	5.85
31	601166	兴业银行	3,798,921.00	5.73
32	600617	国新能源	3,712,806.00	5.60
33	300040	九洲电气	3,639,801.30	5.49
34	600750	江中药业	3,622,280.00	5.46
35	000401	冀东水泥	3,589,640.00	5.41
36	600315	上海家化	3,574,732.00	5.39
37	600385	山东金泰	3,554,818.00	5.36
38	000902	新洋丰	3,450,954.52	5.20
39	002458	益生股份	3,442,184.00	5.19
40	600498	烽火通信	3,263,921.39	4.92
41	601377	兴业证券	3,222,811.00	4.86
42	002234	民和股份	3,132,655.00	4.72
43	300347	泰格医药	2,987,611.00	4.50
44	600486	扬农化工	2,965,697.00	4.47
45	002304	洋河股份	2,907,099.24	4.38
46	600779	*ST水井	2,867,119.00	4.32
47	600805	悦达投资	2,863,000.00	4.32
48	300404	博济医药	2,821,482.00	4.25
49	601818	光大银行	2,820,000.00	4.25
50	300389	艾比森	2,731,320.00	4.12
51	600259	广晟有色	2,681,772.40	4.04
52	002124	天邦股份	2,678,758.00	4.04
53	002365	永安药业	2,606,744.88	3.93
54	600055	华润万东	2,600,141.03	3.92
55	300036	超图软件	2,573,979.00	3.88
56	300190	维尔利	2,496,617.00	3.76
57	002699	美盛文化	2,457,570.40	3.70
58	601688	华泰证券	2,454,219.00	3.70
59	300265	通光线缆	2,431,604.00	3.67
60	600061	国投安信	2,415,591.00	3.64
61	000046	泛海控股	2,362,123.00	3.56
62	300196	长海股份	2,237,359.00	3.37
63	600559	老白干酒	2,195,859.00	3.31
64	002650	加加食品	2,044,579.17	3.08
65	601988	中国银行	2,028,098.00	3.06
66	601328	交通银行	2,024,648.00	3.05
67	000999	华润三九	2,002,801.00	3.02
68	601601	中国太保	2,002,763.00	3.02
69	002684	猛狮科技	1,958,984.00	2.95
70	002400	省广股份	1,956,909.57	2.95
71	300295	三六五网	1,942,685.00	2.93
72	002496	辉丰股份	1,929,470.84	2.91
73	600436	片仔癀	1,920,490.00	2.89
74	600783	鲁信创投	1,873,213.00	2.82
75	600965	福成五丰	1,853,196.00	2.79
76	300261	雅本化学	1,829,563.00	2.76
77	600999	招商证券	1,821,176.00	2.75
78	002039	黔源电力	1,771,502.00	2.67
79	600536	中国软件	1,620,626.29	2.44
80	300398	飞凯材料	1,615,400.10	2.44
81	000908	景峰医药	1,568,152.00	2.36
82	000568	泸州老窖	1,557,479.00	2.35
83	000587	金叶珠宝	1,435,643.00	2.16
84	300027	华谊兄弟	1,366,149.00	2.06
85	002178	延华智能	1,355,274.00	2.04
86	000651	格力电器	1,351,005.00	2.04
87	600030	中信证券	1,350,951.00	2.04
88	600028	中国石化	1,350,948.00	2.04
89	601225	陕西煤业	1,350,684.00	2.04
90	600648	外高桥	1,349,857.52	2.03
91	000333	美的集团	1,349,805.00	2.03
92	600875	东方电气	1,349,718.13	2.03
93	600036	招商银行	1,347,930.00	2.03
94	600837	海通证券	1,347,422.00	2.03
95	002368	太极股份	1,341,963.48	2.02
96	600310	桂东电力	1,341,200.00	2.02
97	601169	北京银行	1,339,747.00	2.02
98	002241	歌尔声学	1,339,682.00	2.02
99	600547	山东黄金	1,335,929.78	2.01
100	300133	华策影视	1,335,749.68	2.01
101	002236	大华股份	1,329,225.00	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300327	中颖电子	13,248,281.51	19.97
2	600588	用友网络	7,836,606.90	11.81
3	600593	大连圣亚	7,725,800.00	11.65
4	000639	西王食品	7,666,572.90	11.56
5	601318	中国平安	7,455,991.60	11.24
6	002100	天康生物	7,266,270.62	10.95
7	300218	安利股份	6,890,515.95	10.39
8	600109	国金证券	6,121,960.29	9.23
9	300059	东方财富	5,943,534.66	8.96
10	601166	兴业银行	5,873,356.14	8.85
11	000712	锦龙股份	5,704,923.16	8.60
12	002234	民和股份	5,242,828.77	7.90
13	002766	索菱股份	5,183,535.42	7.81
14	601688	华泰证券	5,094,467.01	7.68
15	300036	超图软件	4,836,320.76	7.29
16	000001	平安银行	4,494,121.20	6.77
17	600559	老白干酒	4,421,113.52	6.66
18	600211	西藏药业	4,292,655.64	6.47
19	601328	交通银行	4,115,030.40	6.20
20	601601	中国太保	4,075,435.84	6.14
21	000895	双汇发展	4,026,301.12	6.07
22	300265	通光线缆	4,016,943.00	6.06
23	600704	物产中大	3,920,896.36	5.91
24	000858	五 粮 液	3,856,439.25	5.81
25	600783	鲁信创投	3,853,390.54	5.81
26	600498	烽火通信	3,796,516.22	5.72
27	600061	国投安信	3,783,393.74	5.70
28	600750	江中药业	3,701,712.67	5.58
29	600536	中国软件	3,652,815.58	5.51
30	000902	新洋丰	3,636,467.05	5.48
31	601377	兴业证券	3,570,580.00	5.38
32	000069	华侨城A	3,545,857.18	5.35
33	002124	天邦股份	3,447,440.70	5.20
34	600805	悦达投资	3,410,870.00	5.14
35	601908	京运通	3,377,250.46	5.09
36	600036	招商银行	3,223,692.82	4.86
37	600486	扬农化工	3,127,462.79	4.71
38	300389	艾比森	3,121,190.94	4.70
39	600617	国新能源	3,116,544.00	4.70
40	601633	长城汽车	3,111,825.57	4.69
41	300295	三六五网	3,062,794.60	4.62
42	002365	永安药业	3,026,360.45	4.56
43	002699	美盛文化	2,960,984.92	4.46
44	600055	华润万东	2,777,006.80	4.19
45	601818	光大银行	2,730,000.00	4.12
46	000401	冀东水泥	2,723,183.46	4.10
47	600000	浦发银行	2,695,226.98	4.06
48	300404	博济医药	2,685,354.32	4.05
49	002311	海大集团	2,639,659.92	3.98
50	002304	洋河股份	2,625,981.00	3.96
51	002458	益生股份	2,622,256.21	3.95
52	600779	*ST水井	2,507,650.00	3.78
53	000998	隆平高科	2,450,035.02	3.69
54	600965	福成五丰	2,443,799.00	3.68
55	600259	广晟有色	2,400,027.45	3.62
56	600315	上海家化	2,397,214.00	3.61
57	000333	美的集团	2,349,153.50	3.54
58	002496	辉丰股份	2,330,381.61	3.51
59	600436	片仔癀	2,306,889.60	3.48
60	002563	森马服饰	2,277,014.65	3.43
61	000999	华润三九	2,233,553.26	3.37
62	601988	中国银行	2,209,436.00	3.33
63	000908	景峰医药	2,164,117.66	3.26
64	600702	沱牌舍得	2,108,660.49	3.18
65	300063	天龙集团	2,074,571.37	3.13
66	600570	恒生电子	1,993,999.00	3.01
67	002400	省广股份	1,941,590.18	2.93
68	600837	海通证券	1,911,298.00	2.88
69	600015	华夏银行	1,908,129.50	2.88
70	300190	维尔利	1,893,756.30	2.85
71	600895	张江高科	1,867,115.00	2.81
72	002650	加加食品	1,855,248.24	2.80
73	002684	猛狮科技	1,835,710.00	2.77
74	000568	泸州老窖	1,819,295.04	2.74
75	600999	招商证券	1,805,047.75	2.72
76	002039	黔源电力	1,765,058.09	2.66
77	600115	东方航空	1,693,227.00	2.55
78	600875	东方电气	1,678,785.25	2.53
79	000651	格力电器	1,665,568.60	2.51
80	002178	延华智能	1,653,358.76	2.49
81	002462	嘉事堂	1,637,047.06	2.47
82	300398	飞凯材料	1,598,813.00	2.41
83	000750	国海证券	1,580,198.55	2.38
84	000681	视觉中国	1,549,039.00	2.34
85	600079	人福医药	1,547,000.00	2.33
86	600718	东软集团	1,531,313.11	2.31
87	002170	芭田股份	1,517,221.00	2.29
88	002268	卫 士 通	1,476,690.40	2.23
89	002051	中工国际	1,469,239.28	2.21
90	002241	歌尔声学	1,468,048.00	2.21
91	601088	中国神华	1,464,301.11	2.21
92	002368	太极股份	1,451,140.00	2.19
93	002236	大华股份	1,438,672.00	2.17
94	300133	华策影视	1,417,291.21	2.14
95	601225	陕西煤业	1,414,687.00	2.13
96	600030	中信证券	1,411,593.00	2.13
97	000418	小天鹅A	1,393,732.58	2.10
98	002035	华帝股份	1,380,609.00	2.08
99	600028	中国石化	1,370,622.00	2.07
100	600547	山东黄金	1,363,299.68	2.06
101	002482	广田股份	1,342,787.70	2.02
102	600648	外高桥	1,333,792.00	2.01

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	401,651,386.08
卖出股票的收入(成交)总额	354,180,717.65

8.5 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。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	62,568.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,800.12
5	应收申购款	63,196.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	143,565.16

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,433	53,135.43	52,634,109.28	69.13%	23,508,955.54	30.87%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	23,455.02	0.03%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年3月8日)基金份额总额	784,917,869.79
本报告期期初基金份额总额	38,196,327.76
本报告期基金总申购份额	135,004,463.47
减:本报告期基金总赎回份额	97,057,726.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	76,143,064.82

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

管理人浙商基金管理有限公司于2015年3月18日发布《浙商基金管理有限公司关于法定代表人、董事长变更的公告》,公告原董事长高玮女士卸任与肖风先生担任董事长、法定代表人的事项。于2015年5月6日发布《浙商基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》,公告沈阳、聂挺进任公司副总经理的事项。于2015年8月11日发布《浙商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,公告李志惠任公司总经理的事项。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例
招商证券	1	259,171,720.40	34.30%	245,537.68	35.11%
浙商证券	2	134,994,608.73	17.87%	123,522.60	17.67%
世纪证券	1	76,521,004.80	10.13%	69,664.32	9.96%
东方证券	1	75,112,820.20	9.94%	68,683.28	9.82%
申万宏源	1	61,880,055.57	8.19%	56,790.60	8.12%
民生证券	1	52,977,699.70	7.01%	48,307.51	6.91%
中信建投	1	48,414,485.67	6.41%	44,372.69	6.35%
安信证券	1	46,539,483.66	6.16%	42,369.34	6.06%

注:1、券商专用交易单元选择标准:

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其交易单元供本基金证券买卖专用,选择标准为:

(1)遵循国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定的要求;

(2)维护持有人利益,不利用基金资产进行利益输送,不承诺交易量;

(3)以券商服务质量作为席位选择和佣金分配的标准。

2、券商专用交易单元选择程序:

(1)投资管理部、市场部

a、专员与券商联系商讨合作意向,根据公司及基金法律文件中对券商席位的选择标准,并参考中央交易室主管的建议,确定新基金租用或基金新租用席位的所属券商以及(主)席位。

b、报公司分管领导审核通过。

(2)中央交易室

a、专员将我公司格式版本的《证券交易席位使用协议》发送给券商相关业务联系人。

b、券商对我公司提供的协议有修改意见的,其内容若涉及投资管理部、市场部、运营保障部的,由专员分别将此内容发送给上述部门审议,并由专员将我公司各职能部门反馈的意见与券商进行商议,形成一致意见后完成协议初稿,交我公司监察稽核部审核。

c、对券商和我公司双方同意的协议文本进行签字盖章。我公司盖章程序,由专员填写合同流转单,分别送达投资管理部、市场部、运营保障部、监察稽核部签字,最后盖章。

3、本期内本基金券商交易单元变更情况:

(1)新增券商交易单元:安信证券(31899)。

(2)其余租用券商交易单元未发生变动。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
招商证券	5,356,215.70	5.21%	-	-	-	-
浙商证券	28,426,099.58	27.66%	5,000,000.00	11.74%	-	-
世纪证券	9,664,285.40	9.40%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	45,403,843.82	44.18%	36,000,000.00	84.51%	-	-
民生证券	13,912,109.60	13.54%	1,600,000.00	3.76%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

浙商基金管理有限公司
二〇一六年三月二十五日