

浙商聚潮新思维混合型证券投资基金

2019 第二季度报告

2019年6月30日

基金管理人:浙商银行基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月19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。
基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月18日复核了本报告中的财务指标、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	浙商聚潮新思维混合型
代码	160801
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2012年3月9日
跟踪标的名称	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
投资目标	本基金采用自上而下资产配置策略,在严格控制风险的前提下,通过分散投资于中国A股市场中的优质上市公司股票,在科学管理风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下资产配置策略,在严格控制风险的前提下,通过分散投资于中国A股市场中的优质上市公司股票,在科学管理风险的前提下,追求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×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险和收益高于债券型基金、货币型基金,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。
基金管理人	浙商银行基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期利润总额		10,364,013.84
2.净利润		-19,792,668.92
3.期末净资产		-4,080.00
4.期末基金净值		406,978,752.03
5.期末基金份额净值		1.699

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告基金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	1-2	1-2
过去三个月	-4.23%	1.47%	-0.16%	0.88%	-4.07%	0.61%

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%。

本基金业绩比较基准采用复合化过程,需要通过平滑基金资产配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按权重55%、45%的比例采用再平衡,再用每日复利的计算方法得到基准指数的日增长率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

本基金合同生效以来基金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.本基金合同生效日期为2012年3月8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3月8日至2012年9月8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 基金管理人(或基金托管人)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限(自任职日期起)	证券从业年限	说明
顾斌	本基金基金经理、公司总经理	2015年3月30日	8	硕士学历,上海交通大学金融学博士,中国民生银行总行资产管理部副经理,现任浙商银行基金管理有限公司总经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,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,无损害基金份额持有人的利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法律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,本公司严格执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,本公司建立了相对公平的交易价差监控系统,对不同类型的投资组合在交易公开竞价交易时段内同向交易的时间点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。

4.4 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。

4.5 报告期内基金投资的前十名证券的公允价值、占基金资产净值比例及报告期内基金投资的前十名股票公允价值、占基金资产净值比例

注:1.本基金合同生效日期为2012年3月8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3月8日至2012年9月8日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.6 投资组合报告

4.6.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	312,818,564.84	78.91
2	其中:股票	312,818,564.84	78.91
3	固定收益投资	25,509,727.98	6.39
4	其中:债券	25,509,727.98	6.39
5	货币资金	22,071,236.87	5.50
6	其中:结算备付金	-	-
7	衍生金融资产和负债	73,197,094.77	17.74
8	其他资产	596,848.06	0.14
9	合计	412,902,222.51	100.00

4.6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.6.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	医药生物	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水利生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	信息技术	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	公用事业	-	-
L	国防军工	-	-
M	有色金属和贵金属业	-	-
N	化学原料和化学制品制造业	-	-
O	食品饮料、酒类和其他消费品业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	合计	312,818,564.84	78.91

4.6.3 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	300166	晶晨股份	1,553,209	19,711,237.40	4.84
2	600799	华谊兄弟	293,511	18,911,786.58	4.62
3	603223	润兴股份	716,937	17,950,988.94	4.34
4	002311	伟星新材	547,038	16,949,092.20	4.13
5	300567	福陆电子	314,135	16,498,376.20	4.05
6	600887	伊泰股份	474,435	15,683,203.35	3.90
7	600443	爱康集团	288,544	15,080,200.00	3.78
8	600553	亚星客车	263,500	13,655,110.00	3.56
9	002041	迈克股份	1,527,409	13,578,598.00	3.54
10	300146	汉得信息	691,681	13,420,339.00	3.31

4.6.4 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	128624	宁波银行	117,144	15,085,732.25	3.83
2	128647	华商银行	93,634	9,823,955.65	2.41

4.6.5 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资产支持证券投资明细

4.6.5.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

4.6.5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

4.6.5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

4.6.5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

4.6.5.5 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资产支持证券投资明细

4.6.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

4.6.5.7 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资产支持证券投资明细

4.6.5.8 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资产支持证券投资明细

4.6.5.9 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资产支持证券投资明细

4.6.5.10 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资产支持证券投资明细

4.6.5.11 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资产支持证券投资明细

4.6.5.12 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资产支持证券投资明细

4.6.5.13 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资产支持证券投资明细

4.6.5.14 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资产支持证券投资明细

4.6.5.15 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资产支持证券投资明细

4.6.5.16 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资产支持证券投资明细

4.6.5.17 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资产支持证券投资明细

4.6.5.18 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资产支持证券投资明细

4.6.5.19 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资产支持证券投资明细

4.6.5.20 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资产支持证券投资明细

4.6.5.21 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资产支持证券投资明细

4.6.5.22 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资产支持证券投资明细

4.6.5.23 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资产支持证券投资明细

4.6.5.24 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资产支持证券投资明细

4.6.5.25 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资产支持证券投资明细

4.6.5.26 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资产支持证券投资明细

4.6.5.27 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资产支持证券投资明细

4.6.5.28 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资产支持证券投资明细

4.6.5.29 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资产支持证券投资明细

4.6.5.30 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资产支持证券投资明细

4.6.5.31 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资产支持证券投资明细

4.6.5.32 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资产支持证券投资明细

4.6.5.33 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资产支持证券投资明细

4.6.5.34 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资产支持证券投资明细

4.6.5.35 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资产支持证券投资明细

4.6.5.36 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资产支持证券投资明细

4.6.5.37 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资产支持证券投资明细

4.6.5.38 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资产支持证券投资明细

4.6.5.39 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资产支持证券投资明细

4.6.5.40 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资产支持证券投资明细

4.6.5.41 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资产支持证券投资明细

4.6.5.42 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资产支持证券投资明细

4.6.5.43 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资产支持证券投资明细

4.6.5.44 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资产支持证券投资明细

4.6.5.45 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资产支持证券投资明细

4.6.5.46 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资产支持证券投资明细

4.6.5.47 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资产支持证券投资明细

4.6.5.48 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资产支持证券投资明细

4.6.5.49 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资产支持证券投资明细

4.6.5.50 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资产支持证券投资明细

4.6.5.51 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资产支持证券投资明细

4.6.5.52 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资产支持证券投资明细

4.6.5.53 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资产支持证券投资明细

4.6.5.54 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资产支持证券投资明细

4.6.5.55 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资产支持证券投资明细

4.6.5.56 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资产支持证券投资明细

4.6.5.57 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资产支持证券投资明细

4.6.5.58 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资产支持证券投资明细

4.6.5.59 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资产支持证券投资明细

4.6.5.60 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资产支持证券投资明细

4.6.5.61 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资产支持证券投资明细

4.6.5.62 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资产支持证券投资明细

4.6.5.63 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资产支持证券投资明细

4.6.5.64 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资产支持证券投资明细

4.6.5.65 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资产支持证券投资明细

4.6.5.66 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资产支持证券投资明细

4.6.5.67 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资产支持证券投资明细

4.6.5.68 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资产支持证券投资明细

4.6.5.69 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资产支持证券投资明细

4.6.5.70 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资产支持证券投资明细

4.6.5.71 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资产支持证券投资明细

4.6.5.72 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资产支持证券投资明细

4.6.5.73 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资产支持证券投资明细

4.6.5.74 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资产支持证券投资明细

4.6.5.75 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资产支持证券投资明细

4.6.5.76 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资产支持证券投资明细

4.6.5.77 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资产支持证券投资明细

4.6.5.78 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资产支持证券投资明细

4.6.5.79 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资产支持证券投资明细

4.6.5.80 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资产支持证券投资明细

4.6.5.81 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资产支持证券投资明细

4.6.5.82 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资产支持证券投资明细

4.6.5.83 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资产支持证券投资明细

4.6.5.84 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资产支持证券投资明细

4.6.5.85 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资产支持证券投资明细

4.6.5.86 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资产支持证券投资明细

4.6.5.87 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资产支持证券投资明细

4.6.5.88 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资产支持证券投资明细

4.6.5.89 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资产支持证券投资明细

4.6.5.90 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资产支持证券投资明细

4.6.5.91 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资产支持证券投资明细

4.6.5.92 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资产支持证券投资明细

4.6.5.93 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资产支持证券投资明细

4.6.5.94 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资产支持证券投资明细

4.6.5.95 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资产支持证券投资明细

4.6.5.96 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资产支持证券投资明细

4.6.5.97 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资产支持证券投资明细

4.6.5.98 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资产支持证券投资明细

4.6.5.99 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资产支持证券投资明细

4.6.5.100 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资产支持证券投资明细

4.6.5.101 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资产支持证券投资明细

4.6.5.102 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资产支持证券投资明细

4.6.5.103 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资产支持证券投资明细

4.6.5.104 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资产支持证券投资明细

4.6.5.105 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资产支持证券投资明细

4.6.5.106 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资产支持证券投资明细

4.6.5.107 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资产支持证券投资明细

4.6.5.108 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资产支持证券投资明细

4.6.5.109 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资产支持证券投资明细

4.6.5.110 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资产支持证券投资明细

4.6.5.111 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资产支持证券投资明细

4.6.5.112 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资产支持证券投资明细

4.6.5.113 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资产支持证券投资明细

4.6.5.114 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资产支持证券投资明细

4.6.5.115 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资产支持证券投资明细