

## 浙商沪深300指数分级证券投资基金

## 2013第四季度报告

2013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:华夏银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年1月21日

**1.1 重要提示**

基金管理人的董事会及监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。

基金托管人华华夏银行股份有限公司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。

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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金简称 浙商沪深300指数分级 制表时间:浙商300

基金主代码 166002

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2012/05/06

报告期末基金份额总额 106,039,525.76份

基金净值 本基金采用量化投资方式,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理方法,在有效控制风险的前提下,获取指数成份股的有效收益,获得与标的指数相似的回报率及适当的其他收益。

基金经理 陈海峰(本基金的基金经理自2012年5月6日起至今)

基金托管人 华夏银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 浙商稳健 浙商进取 浙商沪深300指数分级 制表时间:浙商300

下属分级基金的交易代码 150076 150077 166002

报告期末下属分级基金的份额总额 11,822,650.00份 11,822,651.00份

基金净值 本基金主要采用量化投资方法,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理方法,在有效控制风险的前提下,获取指数成份股的有效收益,获得与标的指数相似的回报率及适当的其他收益。

投资策略 本基金主要采用量化投资方法,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理方法,在有效控制风险的前提下,获取指数成份股的有效收益,获得与标的指数相似的回报率及适当的其他收益。

业绩比较基准 沪深300所有股票×95%+现金类资产×5%

风险收益特征 本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,从本基金所持有的股票类金融工具来看,浙商稳健具有较低风险,收益相对稳定的特征;浙商进取具有较高风险,高预期收益的特征。

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

下属分级基金的风险收益特征 浙商稳健具有低风险,收益相对稳定的特征;浙商进取具有高风险,高预期收益的特征。

报告期末基金的风险收益特征: 浙商进取份额具有高风险,高预期收益的特征;浙商稳健份额具有低风险,收益相对稳定的特征。

3.1 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2013年10月01日-2013年12月31日

1.本期已实现收益 -1,136,943.87

2.本期利润 -3,565,092.17

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0327

4.期末基金资产净值 93,285,077.44

5.期末基金份额净值 0.8800

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期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 净值增长率① 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 -3.61% 1.05% -0.39% 0.17% -0.52% -0.02%

本基金的业绩比较基准是沪深300指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%。由于基金定期开放,因此每日报出的95%的业绩比较基准不能完全体现。

本基金将通过定期开放机制,在开放期内根据基金净值的实际情况,适时调整资产配置比例,并根据定期开放机制,在开放期的最后一周停止大额申购,并在开放期的最后一周停止赎回。

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

图示了本基金成立以来至报告期末的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比情况。

注:本基金的净值增长率=基金资产净值增长-基金费用之和/基金资产净值初值。

注:本基金基金合同期生效日为2012年5月7日,基金合同生效日至报告期末,本基金的封闭期已满一年。

注:本基金基金合同期生效日为2012年5月7日至2012年12月6日,建仓期结束后各项资产配比均符合基金合同约定。

5.4 管理人报告

5.4.1 基金经理或基金经理助理简介

任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

关永祥 2012年05月07日 - 10 关永祥先生,复旦大学金融学学士,中国科学院研究生院金融工程专业硕士,历任华泰证券有限公司研究所研究员、华泰资产管理有限公司研究员、华泰资产管理有限公司投资经理、华泰资产管理有限公司投资决策委员会委员、国泰基金管理有限公司数据策略研究部研究员。

4.3 个人简介

本基金在报告期内未发生过因数量化投资导致的跟单操作。

4.4 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.5 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.6 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.7 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.8 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.9 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.10 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.11 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.12 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.13 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.14 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.15 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.16 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.17 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.18 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.19 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.20 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.21 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.22 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.23 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.24 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.25 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.26 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.27 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.28 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.29 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.30 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.31 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.32 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.33 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.34 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.35 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.36 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.37 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.38 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.39 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.40 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.41 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.42 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.43 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.44 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.45 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.46 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.47 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.48 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.49 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.50 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.51 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.52 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.53 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.54 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.55 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.56 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.57 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.58 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.59 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.60 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.61 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.62 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.63 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.64 公平交易制度的执行情况

本基金在报告期内未发生过不公平交易的情况。

4.65 公平交易制度的执行情况