
浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金 2018 年年度 报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人:浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2019 年 03 月 28 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会、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。本年度报告已经过全部董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 27 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。

浙江浙商证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、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。

北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金财务出具了无保留意见的审计报告。

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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浙商中证转型成长指数
基金主代码	003366
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月19日
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	49,209,459.72份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.50%，年跟踪误差不超过6%，实现对中证转型成长指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证转型成长指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	95%×中证转型成长指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	浙江浙商证券资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责 姓名	方斌	石立平

人	联系电话	0571-87901630	010-63639180
	电子邮箱	fangbin@stocke.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		95345	95595
传真		0571-87902581	010-63639132

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	www.stocke.com.cn
基金年度报告备置地点	杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区裕民路18号北环中心22层
注册登记机构	浙江浙商证券资产管理有限公司	杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼

§ 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	2018年	2017年	2016-12-19（基金合同生效日）-2016年12月31日
本期已实现收益	-18,982,968.21	8,567,182.49	238,902.02
本期利润	-18,763,785.43	5,147,760.64	245,102.28
本期基金份额净值增长率	-35.64%	1.20%	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末基金资产净值	32,072,575.97	76,160,809.66	225,384,948.37

期末基金份额净值	0.652	1.013	1.001
----------	-------	-------	-------

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-13.76%	1.79%	-11.79%	1.87%	-1.97%	-0.08%
过去六个月	-23.47%	1.50%	-20.35%	1.59%	-3.12%	-0.09%
过去一年	-35.64%	1.43%	-33.73%	1.52%	-1.91%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-34.80%	1.18%	-35.09%	1.28%	0.29%	-0.10%

注：本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 中证转型成长指数收益率 $+5\% \times$ 银行活期存款利率（税后）。基准指数的构建原则如下：

1、中证转型成长指数是由浙商证券资产管理有限公司日前联合中证指数有限公司开发，是成长股投资的策略指数，以2005年12月31日为基日，基点为1000点，并于2014年6月19日起发布。该指数样本股主要包括在经济转型期处于高成长的行业和公司，如TMT、医疗保健、节能环保、高端制造等行业，也包括传统周期性行业中能够成功转型的跨界成长的子行业和公司。

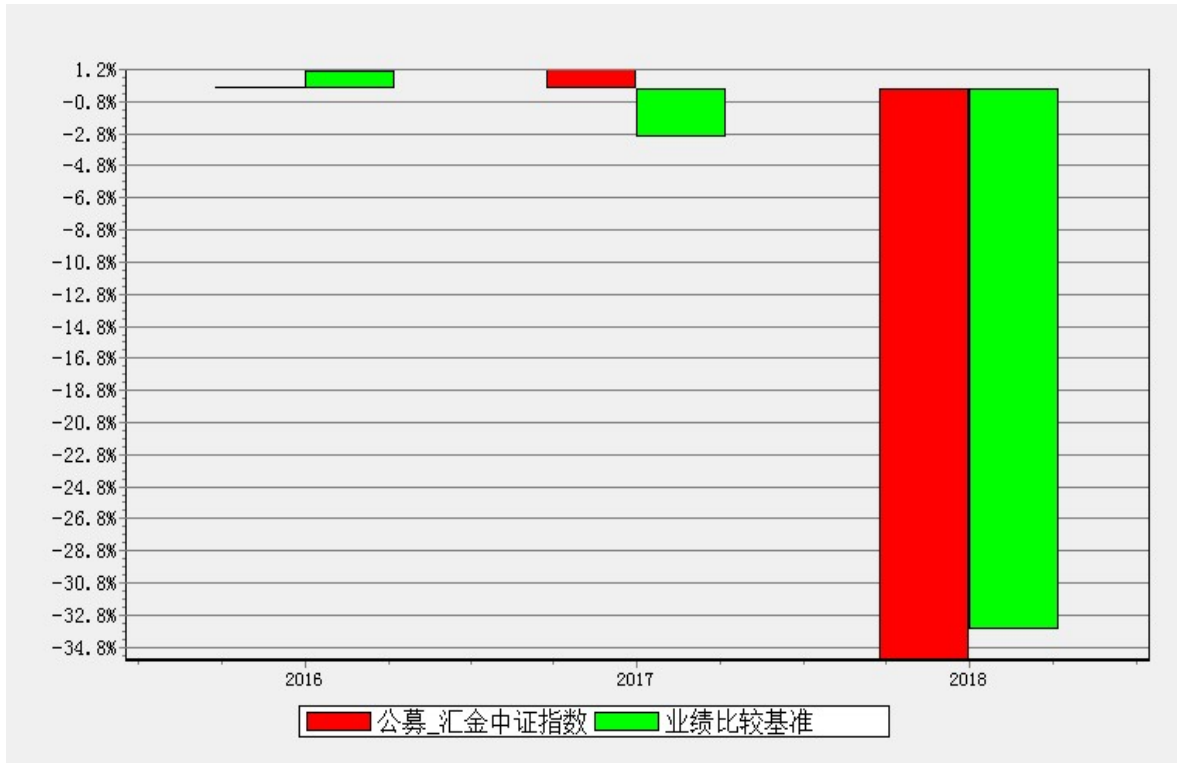
2、由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年12月19日-2018年12月31日)



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：本基金合同生效日为2016年12月19日，基金合同生效当年的相关数据和指标按实际存续期计算，不按照整个自然年度计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2016年12月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日,根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运作情况,无利润分配。

§ 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

浙江浙商证券资产管理有限公司成立于2013年4月18日,是原浙商证券有限责任公司设立的全资子公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准浙商证券有限责任公司设立证券资产管理子公司的批复》(证监许可(2012)1431号)批准,由浙商证券有限责任公司出资5亿元从事资产管理业务。2014年8月19日中国证券监督管理委员会批准《关于核准浙江浙商证券资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》(证监许可(2014)857号)。公司主要经营范围涉及证券资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务。截止2018年12月31日,本基金管理人管理浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金、浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金和浙商汇金短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		
宫幼林	本基金基 金经理	2016-12- 19	-	8年	中国国籍,硕士,历任穆迪Analytics工程师,华安基金管理有限公司高级风险分析师。2014年加入浙江浙商证券资产管理有限公司,担任量化投资部研究员。2016年起任浙商汇金中证转型成长指数型基金基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。

注：上述表格内基金经理的任职日期、离职日期均指公司作出决定并公告披露之日。证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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》、其他相关法律法规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，保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。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 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

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定制定了公司《公平交易管理办法》。公司公平交易体系涵盖研究分析、投资决策、交易执行、交易监控等投资管理活动相关的各个环节，各环节公平措施简要如下：

公司各投资组合共用研究平台、共享信息，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司接受的外部研究报告、内部研究人员撰写的研究报告对公司各投资组合经理开放。

投资组合经理在授权权限范围内做出投资决策，并负责投资决策的具体实施。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。同时，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度。并在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，交易系统将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。

公司合规风控部定期对不同投资组合交易情况进行分析，对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《浙江浙商证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

本产品是被动型指数基金，投资策略就是追踪中证转型成长指数，基准指数选股策略的核心思想是把浙商资管关于成长股的投资理论提炼出来做成一个选股模型，简单来说就是高成长、高景气行业、低市值、低涨幅、业绩有拐点，这里面最核心的选股标准是“高成长”和“低市值”。

2018年全年，基准指数的涨跌幅为-35.27%，产品净值的涨跌幅为-35.64%，略跑输基准指数，但是考虑到产品净值中包含了管理费、托管费以及交易佣金带来的影响，所以产品的净值表现依然是比较优秀的。

另一方面，2018年全年产品日均跟踪偏离度为-0.0028%，小于合同规定的上限0.5%，年化跟踪误差为3.7%，小于合同规定的上限6%，均满足了合同要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商中证转型成长指数基金份额净值为0.652元，本报告期内，基金份额净值增长率为-35.64%，同期业绩比较基准收益率为-33.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前经济的主要问题在于企业、居民、金融机构和资本市场的信心受金融周期回落、信用紧缩和中美贸易摩擦双重冲击，政策传导机制极其不畅。我们推断2019年政策将围绕如何提振信心、缓解信用风险这一主线而展开——预计政府一方面推动开放措施并倒逼改革，另一方面加强逆周期政策（货币、财政、房地产政策等）力度来稳就业。预计政府设定GDP增速目标6.0-6.5%，并争取更好的结果。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定及我司估值政策和程序，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。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货

币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运行情况，本基金在本报告期内未达到基金分配的标准，未进行利润分配。

4.8 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，本基金于2018年5月28日至12月31日持续出现基金资产净值低于5000万元的情形，已上报中国证券监督管理委员会，公司正在推进相关应对方案，本基金未出现基金持有人低于200人的情形。

§ 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，中国光大银行股份有限公司在浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金2018年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 审计报告

北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)对浙江浙商证券资产管理有限公司浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金2018年12月31日的资产负债表，2018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出具了标准无保留意见([2019]京会兴审字第04030070号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产：		
银行存款	2,247,540.17	4,013,653.14
结算备付金	211,750.94	443,177.78
存出保证金	9,894.80	52,045.87
交易性金融资产	29,967,494.00	72,024,916.08
其中：股票投资	29,967,494.00	72,024,916.08
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-

应收证券清算款	-	-
应收利息	619.59	1,287.04
应收股利	-	-
应收申购款	1,185.77	13,430.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	32,438,485.27	76,548,510.15
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2018年12月31日	2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	66,656.37	107,229.05
应付管理人报酬	34,509.25	79,837.50
应付托管费	4,313.67	9,979.67
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	57,804.99	70,431.62
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	202,625.02	120,222.65
负债合计	365,909.30	387,700.49
所有者权益:		
实收基金	49,209,459.72	75,194,316.71
未分配利润	-17,136,883.75	966,492.95
所有者权益合计	32,072,575.97	76,160,809.66
负债和所有者权益总计	32,438,485.27	76,548,510.15

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.652元，基金份额总额49,209,459.72份。

7.2 利润表

会计主体：浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入	-16,889,355.73	9,740,522.24
1. 利息收入	31,523.83	750,706.48
其中：存款利息收入	31,523.83	232,339.84
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	518,366.64
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-17,166,767.63	12,028,534.25
其中：股票投资收益	-17,674,782.96	11,301,357.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	508,015.33	727,176.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	219,182.78	-3,419,421.85
4. 汇兑收益（损失以“-”	-	-

号填列)		
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	26,705.29	380,703.36
减: 二、费用	1,874,429.70	4,592,761.60
1. 管理人报酬	563,874.53	1,659,895.01
2. 托管费	70,484.36	207,486.82
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	887,570.81	2,353,918.40
5. 利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	352,500.00	371,461.37
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-18,763,785.43	5,147,760.64
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-18,763,785.43	5,147,760.64

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金

本报告期: 2018年01月01日至2018年12月31日

单位: 人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018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)	75,194,316.71	966,492.95	76,160,809.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-18,763,785.43	-18,763,785.43
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)	-25,984,856.99	660,408.73	-25,324,448.26

其中：1. 基金申购款	4,015,844.05	-324,095.18	3,691,748.87
2. 基金赎回款	-30,000,701.04	984,503.91	-29,016,197.13
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）	49,209,459.72	-17,136,883.75	32,072,575.97
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017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）	225,139,846.09	245,102.28	225,384,948.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,147,760.64	5,147,760.64
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）	-149,945,529.38	-4,426,369.97	-154,371,899.35
其中：1. 基金申购款	8,469,835.81	213,918.65	8,683,754.46
2. 基金赎回款	-158,415,365.19	-4,640,288.62	-163,055,653.81
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）	75,194,316.71	966,492.95	76,160,809.66

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：

盛建龙

冯建兰

冯建兰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金(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”)(证监许可[2015]2247号)《关于准予浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金注册的批复》批准,由浙江浙商证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金合同》向社会公开发行募集。《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金合同》于2016年12月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为225,139,846.09份基金份额,相关募集业经北京兴华会计师事务所[2016]京会兴浙分验字第68000106号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。基金管理人为浙江浙商证券资产管理有限公司,注册登记机构为浙江浙商证券资产管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)并参照《证券投资基金会计核算业务指引》及《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金合同》的规定而编制的。

本财务报表以持续经营为基础列报。

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于2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
浙商证券股份有限公司	基金管理人的母公司、本基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构
浙江浙商证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

注：本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化，以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12 月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017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
浙商证券股份有限公司	247,485, 750.84	39.57%	654,487, 305.66	38.34%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未发生权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未发生债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12 月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12 月31日	
	债券回购 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
浙商证券股份有限公司	-	-	152,000 ,000.00	100.00%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018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
浙商证券股份有限公司	230,48 1.55	45.47%	11,013.55	19.05%
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017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
浙商证券股份有限公司	609,52 3.34	44.19%	36,208.85	51.41%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元资格，上海证券市场只能使用母公司浙商证券席位进行交易。

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 2018年01月01日至201 8年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	563,874.53	1,659,895.01
其中：支付销售机构的客户维护费	239,521.63	681,501.51

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	70,484.36	207,486.82

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期及上年度可比期间内，未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易的情况。

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

本基金的基金管理人在本报告期间内未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末均未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。

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 2018年01月01日至2018年 12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年1 2月31日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
中国光大银行股份有限公司	2,247,540. 17	26,665.91	4,013,653. 14	210,207.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量（股 ）	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
0007 08	大冶 特钢	2018 -12- 25	重大 资产 重组	8.77	2019 -01- 03	9.65	39,800	373, 571. 00	349, 046. 00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无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。

7.4.10 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	29,967,494.00	92.38
	其中：股票	29,967,494.00	92.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,459,291.11	7.58
8	其他各项资产	11,700.16	0.04
9	合计	32,438,485.27	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）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	356,095.00	1.11
B	采矿业	1,334,031.00	4.16
C	制造业	17,738,937.00	55.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	374,850.00	1.17
E	建筑业	1,348,384.00	4.20
F	批发和零售业	613,502.00	1.91
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	1,050,973.00	3.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,785,850.00	11.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	663,208.00	2.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,434,790.00	4.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	626,193.00	1.95
S	综合	640,681.00	2.00
	合计	29,967,494.00	93.44

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300632	光莆股份	28,800	410,112.00	1.28
2	300123	亚光科技	42,700	389,851.00	1.22
3	603603	博天环境	26,200	387,760.00	1.21
4	300232	洲明科技	39,700	378,738.00	1.18
5	600483	福能股份	44,100	374,850.00	1.17
6	603985	恒润股份	18,000	372,600.00	1.16
7	002244	滨江集团	92,600	368,548.00	1.15
8	600782	新钢股份	72,200	367,498.00	1.15
9	603609	禾丰牧业	47,300	366,575.00	1.14
10	000546	金圆股份	42,300	366,318.00	1.14

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	000789	万年青	2,662,665.10	3.50
2	600282	南钢股份	2,372,738.00	3.12
3	600782	新钢股份	2,260,686.00	2.97
4	000708	大冶特钢	2,184,430.00	2.87
5	601003	柳钢股份	2,152,455.18	2.83
6	300097	智云股份	1,923,282.33	2.53
7	002068	黑猫股份	1,869,069.91	2.45
8	000426	兴业矿业	1,860,105.00	2.44

9	600665	天地源	1,839,740.52	2.42
10	600508	上海能源	1,837,087.00	2.41
11	002110	三钢闽光	1,832,937.00	2.41
12	600507	方大特钢	1,830,059.21	2.40
13	600569	安阳钢铁	1,819,673.00	2.39
14	000672	上峰水泥	1,813,435.00	2.38
15	600153	建发股份	1,813,312.62	2.38
16	600231	凌钢股份	1,786,192.00	2.35
17	600173	卧龙地产	1,695,797.00	2.23
18	000932	华菱钢铁	1,568,345.00	2.06
19	300132	青松股份	1,558,319.00	2.05
20	002039	黔源电力	1,535,902.00	2.02

注：1、表中买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、表中“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	600665	天地源	2,720,476.34	3.57
2	000676	智度股份	2,357,192.54	3.10
3	000789	万年青	2,247,027.00	2.95
4	601003	柳钢股份	2,228,896.76	2.93
5	300338	开元股份	2,222,101.48	2.92
6	300184	力源信息	2,213,322.00	2.91
7	000892	欢瑞世纪	2,207,212.00	2.90
8	603599	广信股份	2,124,135.18	2.79
9	002682	龙洲股份	2,060,946.52	2.71
10	002215	诺普信	2,037,329.00	2.68
11	000498	山东路桥	1,970,769.00	2.59

12	600282	南钢股份	1,967,143.00	2.58
13	002775	文科园林	1,930,410.72	2.53
14	601678	滨化股份	1,920,135.71	2.52
15	601388	怡球资源	1,916,362.00	2.52
16	002283	天润曲轴	1,881,120.93	2.47
17	600782	新钢股份	1,878,595.00	2.47
18	600153	建发股份	1,834,043.00	2.41
19	600569	安阳钢铁	1,828,776.00	2.40
20	600507	方大特钢	1,828,451.00	2.40
21	603518	维格娜丝	1,823,450.44	2.39
22	002088	鲁阳节能	1,806,294.00	2.37
23	000828	东莞控股	1,799,784.39	2.36
24	000672	上峰水泥	1,796,835.00	2.36
25	002562	兄弟科技	1,789,968.82	2.35
26	000708	大冶特钢	1,779,620.98	2.34
27	600508	上海能源	1,760,008.81	2.31
28	600392	盛和资源	1,748,444.88	2.30
29	300097	智云股份	1,732,216.00	2.27
30	000426	兴业矿业	1,710,880.43	2.25
31	002067	景兴纸业	1,678,564.00	2.20
32	002110	三钢闽光	1,664,979.00	2.19
33	000822	山东海化	1,657,038.00	2.18
34	002203	海亮股份	1,643,102.72	2.16
35	600231	凌钢股份	1,615,803.20	2.12
36	002334	英威腾	1,611,221.00	2.12
37	300179	四方达	1,567,146.00	2.06
38	000626	远大控股	1,560,036.00	2.05
39	002039	黔源电力	1,528,447.00	2.01

注：1、表中卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、表中“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	300,561,907.16
卖出股票收入（成交）总额	325,163,729.06

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、表中“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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前十名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

本基金本报告期末进行贵金属投资。

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

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

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 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

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未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,894.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	619.59
5	应收申购款	1,185.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,700.16

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债。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未持有基金投资股票。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
935	52,630.44	-	-	49,209,459.72	100.00%

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	1,905.53	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本报告期末，本基金管理人的高级管理人员，基金投资及研究部门负责人，本基金的基金经理均未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年12月19日)基金份额总额	225,139,846.09
本报告期期初基金份额总额	75,194,316.71
本报告期基金总申购份额	4,015,844.05
减:本报告期基金总赎回份额	30,000,701.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	49,209,459.72

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人的重大人事变动: 2018年5月, 浙江浙商证券资产管理有限公司的董事长由吴承根先生变更为盛建龙先生; 2018年7月, 浙江浙商证券资产管理有限公司的副总经理楼小平先生代为履行总经理职务; 2018年11月, 浙江浙商证券资产管理有限公司的聘任路迹女士担任副总经理职务。上述人事变动, 均已按相关规定备案、公告。

基金托管人的重大人事变动: 2018年5月, 中国光大银行股份有限公司聘任张博先生担任投资与托管业务部总经理职务; 2018年11月, 中国光大银行股份有限公司聘任葛海蛟先生担任中国光大银行股份有限公司行长。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内, 无涉及本基金管理人、基金财产、托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同成立以来一直聘请北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务, 本报告年度的审计费用为42,500元。

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

本报告期内, 本基金管理人和托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	1	377,998,570.06	60.43%	276,428.60	54.53%	-
浙商证券	2	247,485,750.84	39.57%	230,481.55	45.47%	-

注：a) 本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格，上海证券市场只能使用母公司浙商证券席位进行交易。截至报告期末，本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。本报告期内，交易单元无变更。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需
要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额 的比例		购成交 总额的 比例		交总额 的比例		交总额 的比例
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019年1月，浙江浙商证券资产管理有限公司增聘周涛先生为本基金基金经理。上述人事变动，均已按相关规定备案、公告。

2019年2月，浙江浙商证券资产管理有限公司聘任盛建龙先生担任总经理职务。上述人事变动，均已按相关规定备案、公告。

浙江浙商证券资产管理有限公司
二〇一九年三月二十八日