

---

**浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金**

**2019 年半年度报告**

2019 年 06 月 30 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:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。本半年度报告已经过全部董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年03月25日（基金合同生效日）起至2019年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 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	44
7.7 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	44
7.8 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	44
7.9 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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3 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	46

§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
10.2 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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
11.1 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.....	51
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	浙商汇金量化精选混合
基金主代码	006449
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年03月25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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	116,449,341.98份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用数量化方法进行资产配置和个股精选，力争在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用以股票投资为主，固定收益类资产管理为辅的投资策略。本基金一方面通过量化资产配置策略，进行股票、债券等各类资产组合间的比例调整，另一方面通过量化选股模型选择优势股票组合，以期实现高于业绩基准的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金为灵活配置混合型基金，以追求基金资产收益长期增长为目标，在本基金的投资范围内对各类别资产进行灵活的比例配置调整，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。</p> <p>在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可灵活配置降至0%。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金以多因子选股策略为主体、事件驱动策略为补充，精选个股进行组合配置，从而追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p>

业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债总财富指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

## 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌	贺倩
	联系电话	0571-87901630	010-66060069
	电子邮箱	fangbin@stocke.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95345	95599
传真		0571-87902581	010-68121816
注册地址		杭州市下城区天水巷25号	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		310000	100031
法定代表人		盛建龙	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.stocke.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机	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

构		证券大楼七楼
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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期（2019年03月25日（基金合同生效日）- 2019年06月30日）
本期已实现收益	491,213.30
本期利润	5,303,452.85
加权平均基金份额本期利润	0.0222
本期加权平均净值利润率	2.22%
本期基金份额净值增长率	3.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配利润	326,661.80
期末可供分配基金份额利润	0.0028
期末基金资产净值	120,795,976.90
期末基金份额净值	1.0373
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2019年06月30日）
基金份额累计净值增长率	3.73%

注：1、本基金合同于2019年3月25日起生效，自合同生效日起至报告期末不足半年。

2、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。

3、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。

4、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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	3.97%	1.33%	3.02%	0.56%	0.95%	0.77%
过去三个月	3.74%	0.76%	-0.23%	0.74%	3.97%	0.02%
自基金合同生效起至今	3.73%	0.72%	0.44%	0.77%	3.29%	-0.05%

注：本基金投资的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中债总财富指数收益率×50%

1、沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

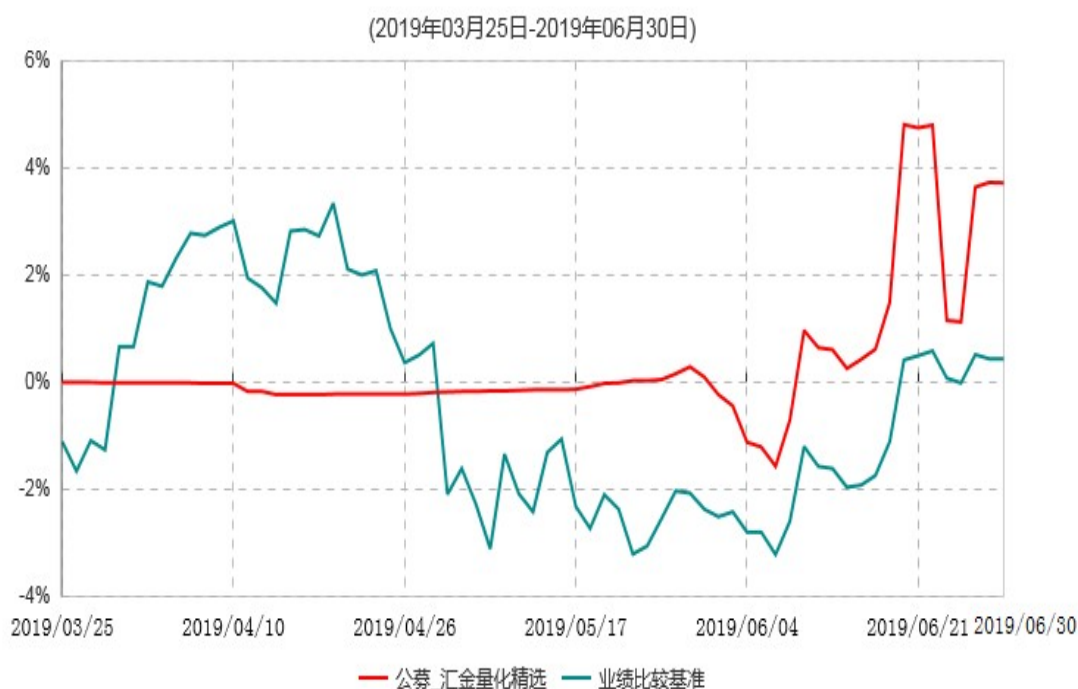
2、中债总财富指数是中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要债券类证券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

3、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50%、50%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



浙商汇金量化精选灵活配置混合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



注：本基金自合同生效日2019年3月25日起至披露时点不满一年，本基金至报告期尚未完成建仓。

## § 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下发的《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）批准成立，2014年8月19日又经中国证券监督管理委员会下发的《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）批准可以从事公募基金管理业务。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2019年6月30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（LOF）、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、浙商汇金短债债券型证券投资基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚鑫定期开放

债券型发起式证券投资基金、浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金聚盈中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		
周涛	总经理助理；本基金基金经理；浙商汇金转型成长混合型基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型基金及浙商汇金中证转型成长指数型基金的基金经理	2019-04-10	—	13 年	中国国籍，硕士，曾任国金证券研究所首席行业分析师、齐鲁证券研究所所长、浙商证券证券投资部总经理、浙商资本副总经理。2017年加入浙江浙商证券资产管理有限公司，现任总经理助理、浙商汇金转型成长混合型基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型基金、浙商汇金中证转型成长指数型基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型基金基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
宫幼林	—	2019-03-25	2019-04-10	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。历任浙商汇金中证转型成长指数型基金、浙

					商汇金量化精选灵活配置 混合型基金的基金经理。 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合规守信情况的说明

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,以确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。

### 4.3.2 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

报告期内,本基金实现净值增长3.73%,跑赢业绩比较基准及沪深300等主要市场指数。本基金自3月底成立以来首先采取保守策略,在市场出现阶段性低点之后才开始建仓,随后逐步加仓,因此减少了本报告期市场出现大幅波动时贝塔对基金净值的负面扰动。此外,我们的量化选股模型也把握住了市场强势板块和个股,发掘了阿尔法。因此在二季度末本基金净值表现较好,在获取绝对收益的同时,相对于沪深300指数本基金也获取了一定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商汇金量化精选混合基金份额净值为1.0373元，本报告期内，基金份额净值增长率为3.73%，同期业绩比较基准收益率为0.44%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年，影响资产市场中短期的三大主体因素（经济增速、流动性环境、风险度偏好）逐步趋于友好。虽然无法判断中美贸易摩擦未来走势，但中美贸易摩擦对A股负面影响开始边际趋弱。相机决策的宏观政策手段将全面对冲经济下滑的担忧，未来经济企稳将是大概率事件。此外本基金运用的大类资产配置模型数据指标显示，未来2-3个季度资产配置大方向依然偏向于股权类资产。总体而言，本基金管理人对未来资本市场，特别是股票市场持积极乐观态度。在执行合理资产配置策略前提下，并将运用成熟的量化选股模型，力争实现稳定的超额收益。

#### 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 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，本基金未发生《公开募集证券投资基金运行管理办法》的第四十一条所述情形。

### § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-浙江浙商证券资产管理有限公司2019年3月25日（基金合同生效日）至 2019年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，浙江浙商证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，浙江浙商证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年06月30日
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	25,627,218.57
结算备付金		1,967,082.25
存出保证金		35,553.56
交易性金融资产	6.4.7.2	94,599,673.94
其中：股票投资		94,599,673.94
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	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	2,349.65
应收股利		—
应收申购款		224,947.66
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		122,456,825.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		847,178.20
应付管理人报酬		533,192.44
应付托管费		88,865.41
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	140,219.49
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	51,393.19
负债合计		1,660,848.73
<b>所有者权益：</b>		

实收基金	6.4.7.9	116,449,341.98
未分配利润	6.4.7.10	4,346,634.92
所有者权益合计		120,795,976.90
负债和所有者权益总计		122,456,825.63

注：1、本基金基金合同生效期为2019年3月25日。截止报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2、报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0373元，基金份额总额116,449,341.98份。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
一、收入		6,683,793.90
1. 利息收入		1,586,614.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	335,354.32
债券利息收入		815,590.46
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		435,669.98
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-266,428.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-735,214.91
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-531,099.82
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	999,885.99
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.18	4,812,239.55

填列)		
4. 汇兑收益 (损失以 “-” 号填列)		-
5. 其他收入 (损失以 “-” 号填列)	6. 4. 7. 19	551, 368. 33
<b>减：二、费用</b>		1, 380, 341. 05
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	954, 321. 24
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	159, 053. 50
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 20	208, 576. 24
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3, 619. 74
7. 其他费用	6. 4. 7. 21	54, 770. 33
<b>三、利润总额 (亏损总额以 “-” 号填列)</b>		5, 303, 452. 85
减：所得税费用		-
<b>四、净利润 (净亏损以 “-” 号填列)</b>		5, 303, 452. 85

注：本基金基金合同生效期为2019年3月25日。截止报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年03月25日 (基金合同生效日) 至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年03月25日 (基金合同生效日) 至2019年06月30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)	284, 979, 059. 83	-	284, 979, 059. 83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	5, 303, 452. 85	5, 303, 452. 85
三、本期基金份额交	-168, 529, 717. 85	-956, 817. 93	-169, 486, 535. 78



易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	2,071,009.92	15,748.78	2,086,758.70
2. 基金赎回款	-170,600,727.77	-972,566.71	-171,573,294.48
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)	116,449,341.98	4,346,634.92	120,795,976.90

注: 本基金基金合同生效期为2019年3月25日。截止报告期末本基金合同生效未满一年, 本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2018]1387号《关于准予浙商汇金量化精选灵活配置混合型发起式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《浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》向社会公开发行业募集。《浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2019年3月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为284,979,059.83份。

相关募集业经北京兴华会计师事务所[2019]京会兴浙分验字第68000008号验资报告予以验证。本基金为混合型证券投资基金,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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定而编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的要求，真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年3月25日至2019年6月30日的经营成果和基金资产净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制，即自每年1月1日至12月31日为一个会计年度。本报告会计期间为2019年3月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（包括交易性金融资产和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产）、贷款和应收款项。

金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债）、其他金融负债。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1) 贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1) 按照《企业会计准则第13号——或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第14号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金的记账基础为权责发生制。除基金投资、股票投资、债券投资和配股权证按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

#### 6.4.4.6 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。当本基金 1) 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；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

每份计划份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的计划份额总额。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益

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认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1. 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
2. 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；
3. 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在证券回购期内逐日计提；
4. 股票、基金投资收益于卖出股票、基金成交日确认，并按卖出股票、基金成交金额与其成本的差额入账，同时调整公允价值变动损益；
5. 债券投资收益于成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额入账，同时调整公允价值变动损益；
6. 衍生工具投资收益于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账，同时调整公允价值变动损益；
7. 股利收益于除息日确认，并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入账；
8. 公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；
9. 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

##### 1. 管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费；

E 为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3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、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

##### 2. 托管人的托管费：

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3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、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 3. 按照国家有关规定可以列入的其他费用

基金合同生效后与基金相关的信息披露费用、基金合同生效后与基金相关的会计师事务所费、律师费、诉讼费和仲裁费、基金份额持有人大会费用、基金的证券、期货交易费用、基金的银行汇划费用、基金的账户开户费用、账户维护费用以及按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 4. 基金税收

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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4次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，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；

3、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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
活期存款	25,627,218.57
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	25,627,218.57

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		89,787,434.39	94,599,673.94	4,812,239.55
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	89,787,434.39	94,599,673.94	4,812,239.55

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末，未持有任何衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末，未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	1,448.45
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	885.20
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	16.00
合计	2,349.65

注：其他为结算保证金应收利息。

#### 6.4.7.6 其他资产



本基金在本报告期末，无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	140,219.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	140,219.49

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,871.83
预提费用	49,521.36
合计	51,393.19

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	284,979,059.83	284,979,059.83
本期申购	2,071,009.92	2,071,009.92
本期赎回（以“-”号填列）	-170,600,727.77	-170,600,727.77
本期末	116,449,341.98	116,449,341.98

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

2、本基金合同于2019年3月25日生效，基金合同生效日的基金份额总额为284,968,675.75，其中认购资金利息折合10,384.08份基金份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	491,213.30	4,812,239.55	5,303,452.85
本期基金份额交易产生的变动数	-164,551.50	-792,266.43	-956,817.93
其中：基金申购款	-1,255.89	17,004.67	15,748.78
基金赎回款	-163,295.61	-809,271.10	-972,566.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	326,661.80	4,019,973.12	4,346,634.92

本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
活期存款利息收入	73,061.55
定期存款利息收入	257,466.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,773.70
其他	52.40
合计	335,354.32

注：其他为结算保证金应收利息。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
卖出股票成交总额	51,111,779.12
减：卖出股票成本总额	51,846,994.03
买卖股票差价收入	-735,214.91

**6.4.7.13 基金投资收益**

本基金本报告期无基金投资收益。

**6.4.7.14 债券投资收益****6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年 06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-531,099.82
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-531,099.82

**6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	83,878,013.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	83,257,819.00
减：应收利息总额	1,151,294.31
买卖债券差价收入	-531,099.82

**6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期未进行资产支持证券投资。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

**6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益****6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	999,885.99
基金投资产生的股利收益	-
合计	999,885.99

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
1. 交易性金融资产	4,812,239.55
——股票投资	4,812,239.55
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	4,812,239.55

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
基金赎回费收入	551,368.33
合计	551,368.33

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
交易所市场交易费用	208,576.24
银行间市场交易费用	—
合计	208,576.24

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
审计费用	14,769.58
信息披露费	34,751.78
汇划手续费	5,248.97
合计	54,770.33

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截止本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本报告披露日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

##### 6.4.9.2 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
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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构

注：以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	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	153,573,395.99	79.69%

本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内未发生权证交易。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
浙商证券股份有限公司	107,664,990.50	100.00%

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	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	460,000,000.00	82.14%

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30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	112,307.11	80.09%	112,307.11	80.09%

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。

3、本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	954,321.24
其中：支付销售机构的客户维护费	582,624.08

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3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、公休假等，支付日期顺延。

2、本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	159,053.50

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$



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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期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。

本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内，基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金在本报告期末未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

#### 6.4.10.5 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 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	25,627,218.57	73,061.55

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.6 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无在承销期参与关联方承销证券的情况。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内未发生其他关联交易事项。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

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，本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	-	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 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。

###### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照全面风险管理的要求，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

公司建立了“董事会—经营管理层—合规风控部”三级风险管理体系，董事会主要负责设定公司的风险偏好和制订风险管理授权体系；公司经营层主要负责执行经董事会批准的风险管理政策；合规风控部门具体履行合规与风险管理职能，对各类风险进行评估和动态监控。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行农业银行，因而与该银行存款相关的信用风险较小。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有债券。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有同业存单。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有债券。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有同业存单。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除6.4.12列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2019年06 月30日	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	
银行存款	25,627,218.57	-	-	-	-	25,627,218.57
清算备付金	1,967,082.25	-	-	-	-	1,967,082.25
存出保证金	35,553.56	-	-	-	-	35,553.56
交易性金融资产	94,599,673.94	-	-	-	-	94,599,673.94
资产总计	122,229,528.32	-	-	-	-	122,229,528.32
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	122,229,528.32	-	-	-	-	122,229,528.32

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

截止本报告期末，本基金持有流通受限资产占基金资产净值的比例为0.02%，占比较低。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	25,627,218.57	-	-	-	-	-	25,627,218.57
结算备付金	1,967,082.25	-	-	-	-	-	1,967,082.25
存出保证金	35,553.56	-	-	-	-	-	35,553.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	94,599,673.94	94,599,673.94
应收利息	-	-	-	-	-	2,349.65	2,349.65
应收申购款	-	-	-	-	-	224,947.66	224,947.66
资产总计	27,629,854.38	-	-	-	-	94,826,971.25	122,456,825.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	847,178.20	847,178.20
应付管	-	-	-	-	-	533,192.44	533,192.44

理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	88,865.41	88,865.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	140,219.49	140,219.49
其他负债	-	-	-	-	-	51,393.19	51,393.19
负债总计	-	-	-	-	-	1,660,848.73	1,660,848.73
利率敏感度缺口	27,629,854.38	-	-	-	-	93,166,122.52	120,795,976.90

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末本基金未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
----	--------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	94,599,673.94	78.31
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	94,599,673.94	78.31

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深300指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量均不发生变化。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2019年06月30日
	1、沪深300指数上涨5%	2,019,706.92
	2、沪深300指数下跌5%	-2,019,706.92

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金的基金合同生效日为2019年3月25日。基金合同生效日至报告期末不满180天，无法计算风险价值收益。

#### 6.4.14 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	94,599,673.94	77.25
	其中：股票	94,599,673.94	77.25
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	27,594,300.82	22.53
8	其他各项资产	262,850.87	0.21
9	合计	122,456,825.63	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	32,216,203.49	26.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	8,610,093.00	7.13



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	4,686,945.00	3.88
J	金融业	37,793,340.00	31.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,269,985.85	9.33
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	94,599,673.94	78.31

### 7.2.2 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。

### 7.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601888	中国国旅	127,129	11,269,985.85	9.33
2	600036	招商银行	287,500	10,344,250.00	8.56
3	601318	中国平安	109,900	9,738,239.00	8.06
4	601166	兴业银行	509,700	9,322,413.00	7.72
5	601933	永辉超市	843,300	8,610,093.00	7.13
6	600887	伊利股份	255,900	8,549,619.00	7.08

7	600030	中信证券	291,000	6,928,710.00	5.74
8	600585	海螺水泥	131,400	5,453,100.00	4.51
9	000333	美的集团	102,300	5,305,278.00	4.39
10	600271	航天信息	207,600	4,785,180.00	3.96
11	002555	三七互娱	345,900	4,686,945.00	3.88
12	000895	双汇发展	188,041	4,680,340.49	3.87
13	000902	新洋丰	161,400	1,731,822.00	1.43
14	600031	三一重工	130,800	1,710,864.00	1.42
15	601688	华泰证券	65,400	1,459,728.00	1.21
16	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.02

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	12,692,412.84	10.51
2	600036	招商银行	11,277,795.00	9.34
3	601166	兴业银行	10,511,775.30	8.70
4	601888	中国国旅	10,106,875.87	8.37
5	603019	中科曙光	9,991,557.40	8.27
6	600887	伊利股份	9,539,765.00	7.90
7	601933	永辉超市	8,599,220.00	7.12
8	600900	长江电力	8,327,502.52	6.89
9	600030	中信证券	5,949,837.89	4.93
10	601668	中国建筑	5,597,760.00	4.63
11	600585	海螺水泥	5,219,086.06	4.32
12	000333	美的集团	5,121,403.98	4.24
13	600271	航天信息	4,829,790.00	4.00
14	601919	中远海控	4,759,273.92	3.94
15	000895	双汇发展	4,751,848.66	3.93

16	000963	华东医药	4,682,377.00	3.88
17	002555	三七互娱	4,370,083.84	3.62
18	002299	圣农发展	4,263,825.80	3.53
19	000002	万 科 A	3,116,220.90	2.58
20	600511	国药股份	2,075,226.00	1.72

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603019	中科曙光	9,190,700.00	7.61
2	600900	长江电力	8,261,042.77	6.84
3	601668	中国建筑	5,864,771.58	4.86
4	601919	中远海控	4,907,551.65	4.06
5	000963	华东医药	4,259,490.00	3.53
6	601318	中国平安	4,247,605.00	3.52
7	002299	圣农发展	3,636,617.96	3.01
8	000002	万 科 A	3,226,349.97	2.67
9	600511	国药股份	2,080,444.00	1.72
10	600887	伊利股份	1,417,996.00	1.17
11	601166	兴业银行	1,416,937.19	1.17
12	601088	中国神华	1,357,354.00	1.12
13	600036	招商银行	1,244,919.00	1.03

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。

### 7.4.3 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	141,634,428.42
卖出股票收入（成交）总额	51,111,779.12

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。

### 7.5 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。

### 7.6 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。

### 7.7 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。

### 7.8 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

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

**7.11.2 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。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 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。**

**7.12.2 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。**

**7.12.3 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	35,553.56
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,349.65
5	应收申购款	224,947.66
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	262,850.87

**7.12.4 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可转债。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**§ 8 基金份额持有人信息**

## 8.1 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
2,410	48,319.23	22,621,458.91	19.43%	93,827,883.07	80.57%

## 8.2 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	10,696.06	0.01%

## 8.3 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：

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年03月25日)基金份额总额	284,979,059.83
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,071,009.92
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	170,600,727.77
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	116,449,341.98

注：上表列示的总申购份额含红利再投、转换入份额，列示的总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会,无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 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: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及法定代表人职务,上述人事变动,已按相关规定备案、公告。

基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动:2019年1月,中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019年4月,中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内,无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,基金管理人、托管人的业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
长江	1	35,923,354.98	18.64%	25,552.93	18.22%	-

证券						
申万宏源	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	3, 226, 349. 97	1. 67%	2, 359. 45	1. 68%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	153, 573, 395. 99	79. 69%	112, 307. 11	80. 09%	-

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，租用了海通证券007362席位、租用了申万宏源201817席位、租用了长江证券003410席位、租用了国泰君安007682席位。

b) 本公司作为浙商证券股份有限公司的全资子公司，根据交易所一般要求，优先租用浙商证券的交易单元。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、个股分析报告及丰富全面的信息；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。

## 10.7.2 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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例



				比例				
长江证券	-	-	50,000,000.00	8.93%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	50,000,000.00	8.93%	-	-	-	-
浙商证券	107,664,990.50	100.00%	460,000,000.00	82.14%	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浙江浙商证券资产管理有限公司关于总经理（法定代表人）变更的公告	上海证券报、公司官网	2019-02-15
2	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金风险评估报告	公司官网	2019-02-15
3	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报、公司官网	2019-02-15
4	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	上海证券报、公司官网	2019-02-15
5	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司官网	2019-02-15
6	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议	上海证券报、公司官网	2019-02-15
7	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	上海证券报、公司官网	2019-02-15
8	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金合	上海证券报、公司官网	2019-03-26

	同生效公告		
9	浙商汇金量化精选灵活配置 混合型证券投资基金基金经 理变更公告	上海证券报、公司官网	2019-04-12
10	关于增加诺亚正行基金销售 有限公司为旗下基金销售机 构并参与其费率优惠活动的 公告	上海证券报、公司官网	2019-05-25
11	浙商汇金量化精选灵活配置 混合型证券投资基金参与浙 商证券股份有限公司费率优 惠活动的公告	上海证券报、公司官网	2019-05-25
12	浙商汇金量化精选灵活配置 混合型证券投资基金开放日 常申购及定期定额投资业务 公告	上海证券报、公司官网	2019-05-25
13	浙商汇金量化精选灵活配置 混合型证券投资基金参与浙 江浙商证券资产管理有限公司 直销费率优惠活动的公告	上海证券报、公司官网	2019-05-25
14	关于增加中信建投证券股份 有限公司为浙江浙商证券资 产管理有限公司旗下部分公 募基金销售机构的公告	上海证券报、公司官网	2019-06-01
15	关于增加扬州国信嘉利基金 销售有限公司为旗下部分公 募基金销售机构并参与其费 率优惠活动的公告	上海证券报、公司官网	2019-06-01
16	浙江浙商证券资产管理有限 公司旗下部分开放式基金转 换业务规则说明的公告	上海证券报、公司官网	2019-06-18
17	浙江浙商证券资产管理有限 公司关于旗下部分基金可投 资科创板股票的公告	上海证券报、公司官网	2019-06-25

18	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下基金持有的中科曙光股票估值方法调整的公告	上海证券报、公司官网	2019-06-26
19	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金半年度最后一个市场交易日净值公告	上海证券报、公司官网	2019-06-29

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准设立浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金的文件；  
《浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；  
《浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；  
报告期内在指定报刊上披露的各项公告；  
基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查询；亦可通过公司网站查阅，公司网址为：  
[www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)。

浙江浙商证券资产管理有限公司  
二〇一九年八月二十六日