
浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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01月01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	7
§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	8
§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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§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	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	44
§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	45
8.2 期末上市基金前十名持有人	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46

8.4 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.....	47
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.....	50
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.....	50
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
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	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	浙商鼎盈事件驱动混合(LOF)
场内简称	浙商鼎盈
基金主代码	169201
基金运作方式	契约型、上市开放式
基金合同生效日	2016年12月07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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	24,456,106.91份
基金合同存续期	不定期
上市日期	2017-03-16

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>在封闭期内，本基金主要投资于定向增发的证券，基金管理人在严格控制风险的前提下，通过对定向增发证券投资价值的深入分析，力争基金资产的长期稳定增值。转为上市开放式基金(LOF)后，本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的基础上，挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下的事件性投资机会，力争基金资产的长期稳定增值。</p>
投资策略	<p>在本基金封闭期内，本基金通过对宏观经济、中观行业分析与定向增发项目优势的深入研究，优选具有较高折价保护并且通过定向增发能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资，形成以定向增发为核心的投资策略，力求基金资产的长期稳健增值。</p> <p>本基金转型为上市开放式基金(LOF)后，本基金将在宏观经济、中观行业分析的基础上，积极寻找事件驱动下的股票二级市场投资机会，形成以事件驱动</p>

	为核心的投资策略，力求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌
	联系电话	0571-87901630
	电子邮箱	fangbin@stocke.com.cn
客户服务电话	95345	95588
传真	0571-87902581	(010) 66105798
注册地址	杭州市下城区天水巷25号	北京市西城区复兴门内大街55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55号
邮政编码	310000	100140
法定代表人	盛建龙	易会满

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

注：本基金在2019年1月21日之前的指定报刊为证券时报，自2019年1月22日起指定报刊为上海证券报。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
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01月01日- 2019年06月30日）
本期已实现收益	4,614,163.89
本期利润	5,678,363.69
加权平均基金份额本期利润	0.1473
本期加权平均净值利润率	14.26%
本期基金份额净值增长率	13.48%
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	1,847,895.04
期末可供分配基金份额利润	0.0756
期末基金资产净值	26,914,338.73
期末基金份额净值	1.1005
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	10.05%

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
过去一个月	7.18%	1.03%	3.92%	0.80%	3.26%	0.23%
过去三个月	-0.34%	1.28%	-0.85%	1.06%	0.51%	0.22%
过去六个月	13.48%	1.24%	18.50%	1.08%	-5.02%	0.16%
过去一年	8.63%	0.91%	7.72%	1.06%	0.91%	-0.15%
自基金合同生效起至今	10.05%	0.64%	8.15%	0.81%	1.90%	-0.17%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。基准指数的构建原则如下：

- 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、中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。
- 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70%、30%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

浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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07日-2019年06月30日)



§ 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		
马斌博	本基金基金经理、浙商汇金转型升级灵活配置混合型及浙商转型成长混合型基金的基金经理	2018-04-19	-	7年	中国国籍，硕士，曾任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司研究员；浙江浙商证券资产管理有限公司研究部研究员；公募基金部基金经理助理；现任浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型基金(LOF)、浙商汇金转型成长混合型、浙商汇金转型升级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

2019上半年,本基金实现净值增长13.5%,跑输主要市场指数。由于18年下半年我们选择了降低仓位来应对下跌风险的策略,19年初仓位较低;随着增量资金加速入场、资本市场改革预期形成以及中美关系的修复,市场上涨速度和节奏超出了我们的预期,本基金未能及时提高仓位,导致一季度错失了部分行情,是跑输市场的主要原因。

上半年,本基金主要持仓分布在食品饮料、医药、券商、新能源、建材、银行、地产、通信、计算机、电子整体持仓均衡,以大消费、大金融为主,科技和传统产业蓝筹为辅,二季度初基于对市场已过度反应乐观预期的判断,我们适当降低了仓位,减持了宏观关联度高的行业个股;季末,随着中美关系的修复以及国内信用分层等风险因素的化解,我们判断市场下行空间有限,整体仓位提升至80%以上,增加了大消费、医药、电子等行业的持仓。从二季度组合表现看,仓位和结构的调整是有效的,跑赢市场。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商鼎盈事件驱动混合(LOF)基金份额净值为1.1005元,本报告期内,基金份额净值增长率为13.48%,同期业绩比较基准收益率为18.50%。

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,中美经贸关系从5月份的急剧恶化正走向边际缓和,未来国内经济增长的外部环境暂时稳定,但仍不能给予过高的预期,下半年由于内生、体质以及结构性问题导致经济下行压力仍将持续存在,三季度经济继续放缓是大概率;在此大背景下,政策会给予适当对冲,以营造相对稳定的宏观环境,财政政策维持积极,货币政策仍有空间,但依赖地产和基建的短周期刺激政策恐将落空,新旧动能转换和高质量发展是主旋律。对于下半年A股市场,投资者对经济下行以及中美关系不确定性和长期性已有比较充分的认知,整体下行风险不大,全球进入宽松周期提振风险偏好,市场将呈现震荡上行走势,结构性机会仍会不断涌现,消费和科技仍是未来的主旋律,本基金下半年将重点关注消费电子、5G、新能源以及消费核心资产的投资机会。

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，本基金自2月20日起持续出现基金资产净值低于5000万元的情形，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，中国工商银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

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	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,450,309.44	41,021,037.70
结算备付金		25,625.23	214,809.07
存出保证金		48,600.57	18,965.77
交易性金融资产	6.4.7.2	21,867,113.98	3,151,135.00
其中：股票投资		21,867,113.98	3,151,135.00
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	-	24,200,000.00
应收证券清算款		-	4,117,606.33
应收利息	6.4.7.5	1,091.47	40,808.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	3,423,451.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		27,392,740.69	76,187,813.32

负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债：			
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		184,843.92	1,698,652.49
应付管理人报酬		32,767.46	87,024.79
应付托管费		5,461.24	14,504.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	149,750.17	95,442.36
应交税费		-	1,758.59
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	105,579.17	162,072.80
负债合计		478,401.96	2,059,455.15
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	24,456,106.91	76,433,465.26
未分配利润	6.4.7.10	2,458,231.82	-2,305,107.09
所有者权益合计		26,914,338.73	74,128,358.17
负债和所有者权益总计		27,392,740.69	76,187,813.32

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.1005元，基金份额总额24,456,106.91份。

6.2 利润表

会计主体：浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入		6,416,051.22	14,027,517.39
1. 利息收入		108,182.11	2,005,814.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,801.29	187,852.79
债券利息收入		11.43	1,786,322.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		39,369.39	31,638.80
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,169,702.01	18,895,624.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,042,322.20	18,281,751.95
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	6,850.16	594,131.21
资产支持证券投资	6.4.7.14.	-	-
收益	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	120,529.65	19,741.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,064,199.80	-7,144,306.78
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	73,967.30	270,385.47
减：二、费用		737,687.53	2,093,630.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	298,816.57	1,569,503.25
2. 托管费	6.4.10.2.	49,802.71	261,583.90

	2		
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	283,211.14	182,767.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		141.72	113.89
7. 其他费用	6.4.7.21	105,715.39	79,661.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,678,363.69	11,933,887.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,678,363.69	11,933,887.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01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）	76,433,465.26	-2,305,107.09	74,128,358.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,678,363.69	5,678,363.69
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）	-51,977,358.35	-915,024.78	-52,892,383.13
其中：1. 基金申购款	3,285,838.46	184,242.43	3,470,080.89

2. 基金赎回款	-55,263,196.81	-1,099,267.21	-56,362,464.02
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)	24,456,106.91	2,458,231.82	26,914,338.73
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018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)	227,359,922.24	-6,183,954.86	221,175,967.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,933,887.25	11,933,887.25
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)	-152,863,531.62	-4,777,643.13	-157,641,174.75
其中: 1. 基金申购款	7,227,836.23	134,158.58	7,361,994.81
2. 基金赎回款	-160,091,367.85	-4,911,801.71	-165,003,169.56
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)	74,496,390.62	972,289.26	75,468,679.88

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

浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金(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[2016]1634号)《关于准予浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合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《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金合同》向社会公开发行募集。《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为227,360,148.23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68000100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,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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。

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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 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。

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	5,450,309.44
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	5,450,309.44

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	20,774,414.78	21,867,113.98	1,092,699.20
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	20,774,414.78	21,867,113.98	1,092,699.20

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	1,058.47
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	11.10
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	21.90
合计	1,091.47

注：其他为结算保证金应收利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金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	149,750.17
银行间市场应付交易费用	-
合计	149,750.17

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	202.78
预提费用	105,376.39
合计	105,579.17

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	76,433,465.26	76,433,465.26
本期申购	3,285,838.46	3,285,838.46
本期赎回（以“-”号填列）	-55,263,196.81	-55,263,196.81
本期末	24,456,106.91	24,456,106.91

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

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

上年度末	-3,799,842.01	1,494,734.92	-2,305,107.09
本期利润	4,614,163.89	1,064,199.80	5,678,363.69
本期基金份额交易产生的变动数	1,033,573.16	-1,948,597.94	-915,024.78
其中：基金申购款	100,499.41	83,743.02	184,242.43
基金赎回款	933,073.75	-2,032,340.96	-1,099,267.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,847,895.04	610,336.78	2,458,231.82

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	64,298.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,140.67
其他	361.93
合计	68,801.29

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01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	95,283,655.72
减：卖出股票成本总额	90,241,333.52
买卖股票差价收入	5,042,322.20

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

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01月01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	6,850.16
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	6,850.16

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01月01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	54,861.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	48,000.00
减：应收利息总额	11.44
买卖债券差价收入	6,850.16

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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

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

本基金本报告期内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01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	120,529.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	120,529.65

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01月01日至2019年06月30日
1. 交易性金融资产	1,064,199.80
——股票投资	1,064,199.80
——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	1,064,199.80

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
基金赎回费收入	73,967.30
合计	73,967.30

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	283,211.14
银行间市场交易费用	-
合计	283,211.14

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	21,075.64
信息披露费	54,547.97
汇划手续费	339.00
其他	29,752.78
合计	105,715.39

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
中国工商银行股份有限公司	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01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30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	107,837,424.82	53.14%	60,165,495.35	62.72%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生权证交易。

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01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的

		比例		比例
浙商证券股份有限公司	18,343.90	33.44%	90,858,958.30	99.54%

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01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30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
浙商证券股份有限公司	49,000,000.00	100.00%	63,300,000.00	100.00%

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01月01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	100,432.08	59.10%	3,058.98	2.04%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总

		量的比例		额的比例
浙商证券股份有限公司	74,828.90	74.10%	5,548.18	14.53%

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。

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01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	298,816.57	1,569,503.25
其中：支付销售机构的客户维护费	41,616.79	309,757.73

注：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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	49,802.71	261,583.90

注：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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，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。

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及上年度可比期间内均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。

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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。

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01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	5,450,309.44	64,298.69	14,401,188.29	186,894.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

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及上年度可比期间均未发生在承销期内未参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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。

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,本报告期内本基金未进行收益分配。

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
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	-	3.46	3.46	7,831	27,095.26	27,095.26	新股认购

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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中国工商银行，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

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

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	5,450,309.44	-	-	-	-	5,450,309.44
清算备付金	25,625.23	-	-	-	-	25,625.23
存出保证金	48,600.57	-	-	-	-	48,600.57
交易性金融资产	21,867,113.98	-	-	-	-	21,867,113.98
资产总计	27,391,649.22	-	-	-	-	27,391,649.22
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	27,391,649.22	-	-	-	-	27,391,649.22
上年度末 2018年12 月31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	41,021,037.70	-	-	-	-	41,021,037.70
清算备付金	214,809.07	-	-	-	-	214,809.07

存出保证金	18,965.77	-	-	-	-	18,965.77
交易性金融资产	3,151,135.00	-	-	-	-	3,151,135.00
买入返售金融资产	24,200,000.00	-	-	-	-	24,200,000.00
资产总计	68,605,947.54	-	-	-	-	68,605,947.54
负债	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	68,605,947.54	-	-	-	-	68,605,947.54

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净值比例为0.10%，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	5,450,309.44	-	-	-	-	-	5,450,309.44
结算备付金	25,625.23	-	-	-	-	-	25,625.23
存出保	48,600.57	-	-	-	-	-	48,600.57

证金							
交易性金融资产	-	-	-	-	-	21,867,113.98	21,867,113.98
应收利息	-	-	-	-	-	1,091.47	1,091.47
资产总计	5,524,535.24	-	-	-	-	21,868,205.45	27,392,740.69
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	184,843.92	184,843.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,767.46	32,767.46
应付托管费	-	-	-	-	-	5,461.24	5,461.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	149,750.17	149,750.17
其他负债	-	-	-	-	-	105,579.17	105,579.17
负债总计	-	-	-	-	-	478,401.96	478,401.96
利率敏感度缺口	5,524,535.24	-	-	-	-	21,389,803.49	26,914,338.73
上年度末2018年12月31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	41,021,037.70	-	-	-	-	-	41,021,037.70
结算备付金	214,809.07	-	-	-	-	-	214,809.07
存出保证金	18,965.77	-	-	-	-	-	18,965.77
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,151,135.00	3,151,135.00
买入返售金融资产	24,200,000.00	-	-	-	-	-	24,200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,117,606.33	4,117,606.33

应收利息	-	-	-	-	-	40,808.11	40,808.11
应收申购款	-	-	-	-	-	3,423,451.34	3,423,451.34
资产总计	65,454,812.54	-	-	-	-	10,733,000.78	76,187,813.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,698,652.49	1,698,652.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	87,024.79	87,024.79
应付托管费	-	-	-	-	-	14,504.12	14,504.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	95,442.36	95,442.36
应交税费	-	-	-	-	-	1,758.59	1,758.59
其他负债	-	-	-	-	-	162,072.80	162,072.80
负债总计	-	-	-	-	-	2,059,455.15	2,059,455.15
利率敏感度缺口	65,454,812.54	-	-	-	-	8,673,545.63	74,128,358.17

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末本基金均未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

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		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	21,867,113.98	81.25	3,151,135.00	4.25
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	21,867,113.98	81.25	3,151,135.00	4.25

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。	
	3、Beta系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去100个交易日与其对应的指数数据回归加权得出。	
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	上年度末 2018年12月31日
	1、沪深300指数上涨5%	1,005,511.17	576,834.38
	2、沪深300指数下跌5%	-1,005,511.17	-576,834.38

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	置信区间为95%		
	观察期为180天		
分析	风险价值	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	风险价值	-419,863.22	-479,297.93
	合计	-419,863.22	-479,297.93

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	21,867,113.98	79.83
	其中：股票	21,867,113.98	79.83
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	5,475,934.67	19.99
8	其他各项资产	49,692.04	0.18
9	合计	27,392,740.69	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	11,245,087.33	41.78
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	523,773.00	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	860,008.00	3.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,578,698.24	5.87
J	金融业	5,511,710.40	20.48
K	房地产业	1,471,733.01	5.47
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	676,104.00	2.51
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,867,113.98	81.25

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通过港股通投资的股票。

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	600030	中信证券	80,018	1,905,228.58	7.08
2	000002	万科A	52,921	1,471,733.01	5.47
3	600887	伊利股份	44,000	1,470,040.00	5.46
4	600276	恒瑞医药	19,560	1,290,960.00	4.80
5	601166	兴业银行	63,800	1,166,902.00	4.34
6	000568	泸州老窖	13,500	1,091,205.00	4.05
7	002223	鱼跃医疗	38,959	959,170.58	3.56
8	300014	亿纬锂能	30,800	938,168.00	3.49
9	002405	四维图新	57,300	922,530.00	3.43
10	002202	金风科技	73,600	914,848.00	3.40
11	000860	顺鑫农业	19,000	886,350.00	3.29
12	600029	南方航空	111,400	860,008.00	3.20
13	600585	海螺水泥	20,600	854,900.00	3.18
14	601688	华泰证券	37,452	835,928.64	3.11
15	601336	新华保险	14,400	792,432.00	2.94
16	601939	建设银行	105,393	784,123.92	2.91
17	000063	中兴通讯	23,700	770,961.00	2.86
18	600438	通威股份	53,700	755,022.00	2.81
19	603259	药明康德	7,800	676,104.00	2.51
20	603986	兆易创新	7,600	658,920.00	2.45
21	600588	用友网络	23,920	642,969.60	2.39
22	002916	深南电路	6,000	611,520.00	2.27

23	601933	永辉超市	51,300	523,773.00	1.95
24	601236	红塔证券	7,831	27,095.26	0.10
25	603217	元利科技	244	16,406.56	0.06
26	603867	新化股份	557	14,376.17	0.05
27	601698	中国卫通	3,367	13,198.64	0.05
28	603915	国茂股份	526	12,240.02	0.05

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	601186	中国铁建	4,105,100.00	5.54
2	603986	兆易创新	3,727,667.20	5.03
3	600837	海通证券	3,696,494.00	4.99
4	002230	科大讯飞	3,475,848.40	4.69
5	600030	中信证券	3,267,168.00	4.41
6	601688	华泰证券	3,128,052.00	4.22
7	002709	天赐材料	2,869,041.00	3.87
8	600498	烽火通信	2,798,683.59	3.78
9	002223	鱼跃医疗	2,794,682.00	3.77
10	600570	恒生电子	2,437,360.86	3.29
11	000860	顺鑫农业	2,427,704.00	3.28
12	603019	中科曙光	2,405,448.00	3.24
13	002035	华帝股份	2,395,920.50	3.23
14	000977	浪潮信息	2,386,828.00	3.22
15	000002	万科A	2,379,028.25	3.21
16	600050	中国联通	2,269,901.00	3.06
17	002405	四维图新	2,089,796.00	2.82
18	600438	通威股份	1,929,992.82	2.60
19	300014	亿纬锂能	1,920,372.00	2.59

20	600104	上汽集团	1,905,377.00	2.57
21	002371	北方华创	1,888,836.00	2.55
22	000418	小天鹅A	1,847,836.00	2.49
23	601233	桐昆股份	1,690,349.00	2.28
24	600029	南方航空	1,682,673.00	2.27
25	600820	隧道股份	1,633,938.62	2.20
26	601288	农业银行	1,630,476.00	2.20
27	300017	网宿科技	1,585,355.00	2.14
28	601601	中国太保	1,562,095.00	2.11
29	002127	南极电商	1,557,079.00	2.10
30	002095	生意宝	1,541,756.00	2.08
31	601328	交通银行	1,508,937.00	2.04

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	600837	海通证券	3,893,567.00	5.25
2	601186	中国铁建	3,889,273.00	5.25
3	002230	科大讯飞	3,629,069.48	4.90
4	603986	兆易创新	3,415,131.40	4.61
5	601601	中国太保	3,312,512.02	4.47
6	600498	烽火通信	3,011,900.00	4.06
7	002709	天赐材料	2,793,739.76	3.77
8	600570	恒生电子	2,755,979.00	3.72
9	601688	华泰证券	2,755,547.40	3.72
10	300017	网宿科技	2,741,668.00	3.70
11	603019	中科曙光	2,507,546.00	3.38

12	000977	浪潮信息	2,471,828.00	3.33
13	600050	中国联通	2,460,980.00	3.32
14	002035	华帝股份	2,290,305.00	3.09
15	002371	北方华创	2,138,517.40	2.88
16	002223	鱼跃医疗	2,124,658.35	2.87
17	600104	上汽集团	1,922,503.00	2.59
18	600030	中信证券	1,829,841.82	2.47
19	000418	小天鹅A	1,828,328.00	2.47
20	002127	南极电商	1,774,360.55	2.39
21	300498	温氏股份	1,705,437.00	2.30
22	600820	隧道股份	1,691,955.00	2.28
23	601288	农业银行	1,665,540.00	2.25
24	601233	桐昆股份	1,663,878.00	2.24
25	000860	顺鑫农业	1,651,639.00	2.23

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	107,893,112.70
卖出股票收入（成交）总额	95,283,655.72

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未参加国债期货交易。

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	48,600.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,091.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,692.04

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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的股票。

§ 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
421	58,090.52	3,518,391.81	14.39%	20,937,715.10	85.61%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例 (%)
1	恒生电子股份有限公司	2,988,182.81	12.22
2	黄国民	992,513.49	4.06

3	周国琴	988,547.29	4.04
4	张田芳	790,837.83	3.23
5	洪忠华	593,128.38	2.43
6	刘书洪	516,035.00	2.11
7	四川长城软件科技股份有限公司	495,009.00	2.02
8	范健飒	494,566.15	2.02
9	仇庆松	494,273.65	2.02
10	徐江华	494,161.15	2.02

注：上述基金持有人均为场内持有人。

8.3 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	113,655.48	0.46%

8.4 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(2016年12月07日)基金份额总额	227,360,148.23
本报告期期初基金份额总额	76,433,465.26
本报告期基金总申购份额	3,285,838.46
减：本报告期基金总赎回份额	55,263,196.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	24,456,106.91

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无重大人事变动。

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

本报告期内基金投资策略无变化。

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	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	

	量					
国泰君安	1	92,941,534.75	45.80%	67,970.07	40.00%	-
海通证券	1	2,139,092.20	1.05%	1,521.54	0.90%	-
浙商证券	2	107,837,424.82	53.14%	100,432.06	59.10%	-

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，交易单元租用了海通证券007810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。

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
国泰君安	36,517.70	66.56%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

浙商证 券	18,343.90	33.44%	49,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
----------	-----------	--------	---------------	---------	---	---	---	---

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	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金年度最后一个市场自然日净值公告	证券时报、公司官网	2019-01-02
2	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)(2018年第2号)	公司官网	2019-01-19
3	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)(摘要)(2018年第2号)	证券时报、公司官网	2019-01-19
4	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金2018年第四季度报告	上海证券报、公司官网	2019-01-22
5	关于增加汇成基金为浙江浙商证券资产管理有限公司旗下公募基金销售机构的公告	上海证券报、公司官网	2019-01-30
6	浙江浙商证券资产管理有限公司关于参加上海奕丰基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、公司官网	2019-02-13
7	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
8	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2018年年度报告摘要	上海证券报、公司官网	2019-03-28
9	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活	公司官网	2019-03-28

	配置混合型证券投资基金(LOF) 2018年年度报告		
10	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 2019年第1季度报告	上海证券报、公司官网	2019-04-18
11	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
12	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
13	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
14	浙商汇金鼎盈事件驱动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鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金的文件；
《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
《浙商汇金鼎盈定增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。

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