

**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 3 季度报告**

**2019 年 09 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

报告送出日期:2019 年 10 月 24 日

## 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示.....                                  | 3  |
| §2 基金产品概况.....                                | 3  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                         | 4  |
| 3.1 主要财务指标.....                               | 4  |
| 3.2 基金净值表现.....                               | 4  |
| §4 管理人报告.....                                 | 5  |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....                      | 5  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....               | 6  |
| 4.3 公平交易专项说明.....                             | 6  |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析.....                     | 6  |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现.....                          | 7  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....                | 7  |
| §5 投资组合报告.....                                | 7  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况.....                         | 7  |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                     | 7  |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细.....     | 8  |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....                   | 9  |
| 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....     | 9  |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细..... | 9  |
| 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....    | 9  |
| 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....     | 9  |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....                 | 9  |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....                | 9  |
| 5.11 投资组合报告附注.....                            | 10 |
| §6 开放式基金份额变动.....                             | 10 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....                    | 11 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....                     | 11 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....                 | 11 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息.....                        | 11 |
| 8.1 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.....        | 11 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                       | 11 |
| §9 备查文件目录.....                                | 11 |
| 9.1 备查文件目录.....                               | 11 |
| 9.2 存放地点.....                                 | 11 |
| 9.3 查阅方式.....                                 | 11 |

## § 1 重要提示

浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年7月1日起至2019年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 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  |
| 报告期末基金份额总额 | 18,353,310.15份   |
| 投资目标       | 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。 |
| 投资策略       | 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。<br>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。  |
| 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  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2019年07月01日 - 2019年09月30日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 950,278.81                     |
| 2. 本期利润         | -51,693.83                     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0025                        |
| 4. 期末基金资产净值     | 20,077,257.57                  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0939                         |

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本期利息收入、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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|    |        |           |            |              |     |     |

|       |        |       |       |       |        |       |
|-------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
|       |        |       |       | ④     |        |       |
| 过去三个月 | -0.60% | 0.91% | 0.05% | 0.67% | -0.65% | 0.24% |

注：本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率\*70%+中国债券总指数收益率\*30%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务  | 任本基金的基金经理期限 |      | 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基金及浙商转型成长混合型基金、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金及浙商汇金 | 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 |

|  |                               |  |  |   |
|--|-------------------------------|--|--|---|
|  | 中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金联接基金的基金经理 |  |  | 助理；现任浙商汇金转型成长混合型基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型基金、浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型基金(LOF)、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金及浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金联接基金的基金经理。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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年三季度，本基金净值下跌0.6%，小幅跑赢沪深300，跑输创业板指数。三季度经济下行压力逐步加大，中美贸易关系反复，市场整体处于宽幅震荡中，行业和个股分化加大，TMT及医药等泛科技类板块表现抢眼，银行地产及传统周期性板块弱势。策

略上，我们判断基本面风险可控，全球宽松周期开启预期加强，尽管仍存在经济下行、通胀预期以及海外市场的不确定性，但A股市场整体仍处于低位，震荡向上的格局不会改变；操作上，本产品主要持仓分布在消费、金融领域大蓝筹，以及新能源、新能源汽车、电子等产业方向，持仓行业分布相对均衡。

#### 4.5 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1.0939元，本报告期内，基金份额净值增长率为-0.60%，同期业绩比较基准收益率为0.05%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金于2019年7月1日至2019年9月30日持续出现基金净值低于5000万的情形，公司已向中国证监会报告并推进相关应对方案，本基金未出现持有人低于200人的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 14,722,991.85 | 72.13            |
|    | 其中：股票             | 14,722,991.85 | 72.13            |
| 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      | 4,926,811.98  | 24.14            |
| 8  | 其他资产              | 760,603.06    | 3.73             |
| 9  | 合计                | 20,410,406.89 | 100.00           |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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              | 9,385,669.20  | 46.75        |
| 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           | 456,057.00    | 2.27         |
| 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  | -             | -            |
| J  | 金融业              | 3,270,917.75  | 16.29        |
| K  | 房地产业             | 663,583.90    | 3.31         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 946,764.00    | 4.72         |
| 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               | 14,722,991.85 | 73.33        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金未持有港股通投资股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 600887 | 伊利股份 | 44,000 | 1,254,880.00 | 6.25         |
| 2  | 601166 | 兴业银行 | 63,800 | 1,118,414.00 | 5.57         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 3  | 000860 | 顺鑫农业 | 19,000  | 991,040.00 | 4.94 |
| 4  | 603259 | 药明康德 | 10,920  | 946,764.00 | 4.72 |
| 5  | 002202 | 金风科技 | 73,600  | 921,472.00 | 4.59 |
| 6  | 600585 | 海螺水泥 | 20,600  | 851,604.00 | 4.24 |
| 7  | 002223 | 鱼跃医疗 | 38,959  | 841,514.40 | 4.19 |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药 | 9,860   | 795,504.80 | 3.96 |
| 9  | 000063 | 中兴通讯 | 23,700  | 758,637.00 | 3.78 |
| 10 | 601939 | 建设银行 | 105,393 | 736,697.07 | 3.67 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末，本基金未持有债券。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末，本基金未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前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。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未参与股指期货交易。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未参与国债期货交易。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券中新华保险于2018年10月18日因未依法履行其他职责，信息披露虚假或严重误导性陈述受到银保监会处罚110万元人民币。

本基金投资上述股票的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。本基金管理人的投研团队对上述上市公司受处罚事件进行了及时分析和跟踪研究。认为该事件对该上市公司投资价值未产生实质性影响。

5.11.2 本基金投资的前十名证券中，没有超出基金合同规定的备选证券库之外的证券。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 18,192.86  |
| 2  | 应收证券清算款 | 741,334.99 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 1,075.21   |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 760,603.06 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |               |
|--------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 24,456,106.91 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 349,249.76    |

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 6,452,046.52  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 18,353,310.15 |

注：总申购份额含红利再投、转入份额，总赎回份额含转出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未发生固有资金申购、赎回本基金的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内未出现其他影响投资者决策的重要信息。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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。

### 9.2 存放地点

杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼。

### 9.3 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

2019年10月24日