

浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金

2019 年年度报告

2019 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:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2020 年 04 月 29 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。本年度报告已经全部董事签字同意，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2020年4月28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。

本报告期自2019年3月25日（基金合同生效日）起至2019年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
8.7 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	54
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	54
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	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
8.12 投资组合报告附注.....	54
§9 基金份额持有人信息.....	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§10 开放式基金份额变动.....	56
§11 重大事件揭示.....	56
11.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
11.4 基金投资策略的改变.....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
11.8 其他重大事件.....	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§13 备查文件目录.....	62
13.1 备查文件目录.....	62
13.2 存放地点.....	62
13.3 查阅方式.....	63

§ 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	126,453,865.70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
	联系电话	0571-87903297
	电子邮箱	fund@stocke.com.cn
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楼	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	310020	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)	北京市西城区裕民路18号北环中心2

	普通合伙)	2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	本期2019年03月25日（基金合同生效日）- 2019年12月31日
本期已实现收益	18,458,352.67
本期利润	40,234,104.33
加权平均基金份额本期利润	0.2585
本期加权平均净值利润率	23.88%
本期基金份额净值增长率	33.84%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末
期末可供分配利润	21,702,622.23
期末可供分配基金份额利润	0.1716
期末基金资产净值	169,249,941.86
期末基金份额净值	1.3384
3.1.3 累计期末指标	2019年末
基金份额累计净值增长率	33.84%

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。

4、本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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		
过去三个月	14.43%	0.83%	4.41%	0.37%	10.02%	0.46%
过去六个月	29.03%	1.04%	5.06%	0.42%	23.97%	0.62%
自基金合同生效起至今	33.84%	0.94%	5.52%	0.57%	28.32%	0.37%

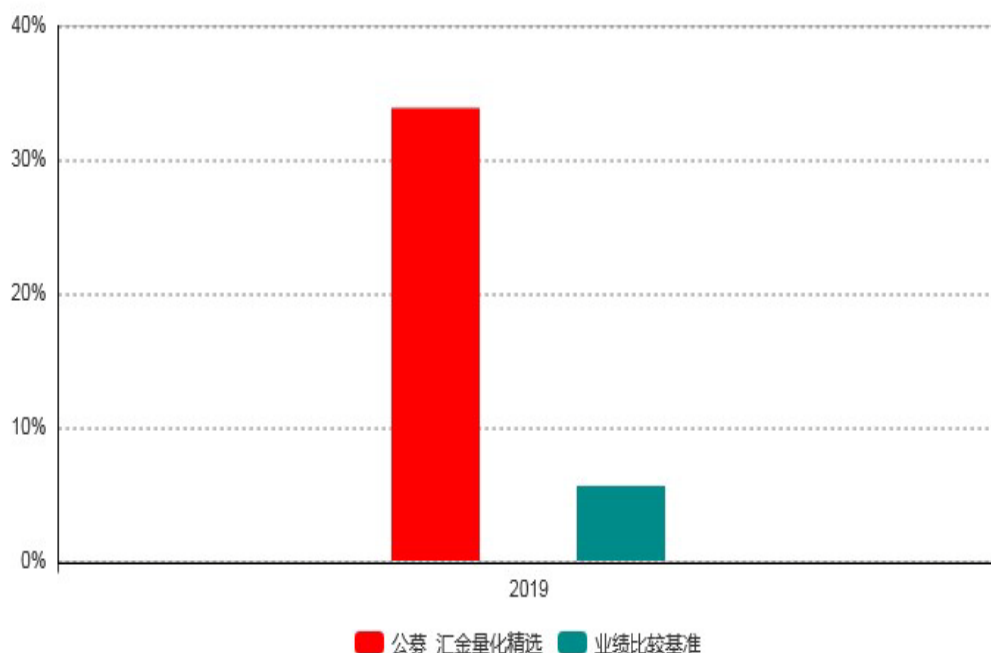
注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率*50%+中债总财富指数收益率*50%。沪深300指数由中证指数有限公司编制，由沪深A股中规模大、流动性好的最具代表性的300只股票组成，综合反映沪深A股市场整体表现。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够反映本基金的风险收益特征。本基金业绩基准指数每日按照50%、50%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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



注：本基金合同生效日为2019年3月25日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。至本报告期末，本基金已完成建仓，但报告期末距建仓结束不满一年，建仓期为2019年3月25日-2019年9月24日，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

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2019年3月25日，基金合同生效日当年的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2019年3月25日（基金合同生效日）至2019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，由浙商证券股份有限公司出资12亿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2019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、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、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金和浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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	-	14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的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
宫幼	本基金基金经理；浙商汇	2019-	2019-	8	中国国籍，硕士，历任穆

林	金中证转型成长指数型基金的基金经理	03-25	04-10	年	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、离职日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写。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，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

报告期内，本基金实现净值增长33.84%，跑赢业绩比较基准及沪深300等主要市场指数，超额收益较明显。

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并逐步加仓，因此减少了市场出现大幅波动时，贝塔对基金净值的负面扰动。下半年，我们结合宏观和市场大环境以及本基金战略资产配置策略，加大权益资产配置，并量化多因子选股模型把握住了市场强势板块和个股，发掘了阿尔法。

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1.3384元，本报告期内，基金份额净值增长率为33.84%，同期业绩比较基准收益率为5.52%。

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2020年市场，无论从估值角度还是股票风险溢价角度，中国股票市场没有被高估，依然处于相对底部区域，另外随着中国资本市场加速开放，人民币计价的资产与海外主要经济体的资产在收益率方面存在明显的优势，因此海外资金加大对中国股市的配置是长期趋势。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2019年，本基金管理人内部监察稽核工作坚持规范运作、防范风险、维护投资人利益的原则，在进一步完善、优化公司内控制度的基础上，严格依据法律法规和公司内控制度监督前后台各部门日常工作，切实防控公司运营和投资组合运作的风险，保障公司稳步发展。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作主要包括以下几个方面：

一、进一步完善、优化公司内控制度，加强监察稽核力度。

报告期间，公司制定了《浙江浙商证券资产管理有限公司风控体系建设实施纲要》、《浙江浙商证券资产管理有限公司固定收益业务信用衍生品投资管理办法》、《浙江浙商证券资产管理有限公司权益类产品投资业务风险管理办法》、《浙江浙商证券资产管理有限公司固定收益公募产品投资管理办法》、《浙江浙商证券资产管理有限公司存款及同业存单投资管理制度》；修订了《浙江浙商证券资产管理有限公司资产管理业务决策委员会议事规则》、《浙江浙商证券资产管理有限公司基金业务会计核算及估值办法》、《浙江浙商证券资产管理有限公司公平交易管理制度》、《浙江浙商证券资产管理有限公司公司集中交易管理办法》、《浙江浙商证券资产管理有限公司资产管理业务权益投资管理办法》。通过新增和修订制度，进一步完善了公司规章制度体系，有效保障了公司相关机构职能的发挥及业务的发展。同时，合规风控部继续严格依据法律法规和公司规章制度独立行使职责，通过定期或不定期检查、专项检查等方式，监督公司各项制度执行情况，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

二、继续加强投资监控，防范投资运作风险。

报告期内，合规风控部通过现场检查、电脑实时监控、人员询问、重点抽查等方式，加强事前、事中、事后的风险管理，同时通过定期对投资组合进行量化风险分析和绩效评估并提供风险分析报告和绩效评估报告等方式进行风险控制，切实贯彻落实公平交易，防范异常交易，确保公司旗下投资组合合法合规运作，切实维护投资人的合法利益。

报告期内，本基金管理人所管理基金的运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，不断完善和优化操作流程，充实和改进内控技术方法与手段，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，防范和控制各种风险，合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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12月31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遵规守信、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《公开募集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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	[2020]京会兴审字第04030062号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金份额持有人
审计意见	我们认为，汇金量化精选混合型投资基金财务报表在所有重大方面按照财政部于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》编制，公允反映了汇金量化精选混合型投资基金2019年12月31日的财务状况以及2019年3月25日（基金合同生效日）至2019年12月31日的经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇金量化精选混合型投资基金，并履行了职业道

	德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>汇金量化精选混合型投资基金的基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估汇金量化精选混合型投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算汇金量化精选混合型投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督汇金量化精选混合型投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为</p>

	<p>发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇金量化精选混合型投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致汇金量化精选混合型投资基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	宜军民、李 鑫
会计师事务所的地址	北京市西城区裕民路18号北环中心22层
审计报告日期	2020-03-18

§ 7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	12,257,720.31
结算备付金		410,923.86
存出保证金		86,530.50
交易性金融资产	7.4.7.2	158,380,842.36
其中：股票投资		158,380,842.36
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,733,027.17
应收利息	7.4.7.5	1,169.74
应收股利		-
应收申购款		300,716.03
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		173,170,929.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-

应付证券清算款		-
应付赎回款		3,166,411.23
应付管理人报酬		216,216.78
应付托管费		36,036.14
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	355,386.68
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	146,937.28
负债合计		3,920,988.11
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	126,453,865.70
未分配利润	7.4.7.10	42,796,076.16
所有者权益合计		169,249,941.86
负债和所有者权益总计		173,170,929.97

注：1、本基金基金合同生效日为2019年3月25日，2019年实际报告期间为2019年3月25日至2019年12月31日。截至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12月31日，基金份额净值1.3384元，基金份额总额126,453,865.70份。

7.2 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12月31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12月31日
一、收入		43,361,887.97
1. 利息收入		1,608,654.58

其中：存款利息收入	7.4.7.11	357,394.14
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）		18,962,500.61
其中：股票投资收益	7.4.7.12	18,142,526.96
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	-531,099.82
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.3	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	1,351,073.47
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	21,775,751.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,014,981.12
减：二、费用		3,127,783.64
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,942,443.81
2. 托管费	7.4.10.2.2	323,740.61
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.20	703,628.71
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	7.4.7.21	154,350.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,234,104.33
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,234,104.33

注：本基金基金合同生效日为2019年3月25日，2019年实际报告期间为2019年3月25日至2019年12月31日。截至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。

7.3 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12月31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)	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)	-	40,234,104.33	40,234,104.33
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)	-158,525,194.13	2,561,971.83	-155,963,222.30
其中：1. 基金申购款	134,915,596.56	21,122,293.89	156,037,890.45
2. 基金赎回款	-293,440,790.69	-18,560,322.06	-312,001,112.75
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)	126,453,865.70	42,796,076.16	169,249,941.86

注：本基金基金合同生效日为2019年3月25日，2019年实际报告期间为2019年3月25日至2019年12月31日。截至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7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

盛建龙

盛建龙

盛建龙

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

浙商汇金量化精选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[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变更注册的批复》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份基金份额，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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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《浙商汇金量化精选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。

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12月31日的财务状况以

及2019年3月25日（基金合同生效日）至2019年12月31日的经营成果和基金资产净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 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三类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融负债在初始确认时划分为以下四类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；（2）金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；（3）不属于上述（1）（2）的财务担保合同，以及不属于（1）并以低于市场利率贷款的贷款承诺；（4）以摊余成本计量的金融资产。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

（1）金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

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。但是，公司初始确认的应收账款未包含重大融资成分或公司不考虑未超过一年的合同中的融资成分的，按照交易价格进行初始计量。

（2）金融资产的后续计量方法

1) 以摊余成本计量的金融资产

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

采用公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

采用公允价值进行后续计量。获得的股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

采用公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

(3) 金融负债的后续计量方法

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）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。对于此类金融负债以公允价值进行后续计量。因公司自身信用风险变动引起的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公允价值变动金额计入其他综合收益，除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配。此类金融负债产生的其他利得或损失（包括利息费用、除因公司自身信用风险变动引起的公允价值变动）计入当期损益，除非该金融负债属于套期关系的一部分。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债

按照《企业会计准则第23号—金融资产转移》相关规定进行计量。

3) 不属于上述1)或2)的财务担保合同，以及不属于上述1)并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 按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；② 初始确认金额扣除按照相关规定所确定的累计摊销额后的余额。

4) 以摊余成本计量的金融负债

采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融负债所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销时计入当期损益。

(4) 金融资产和金融负债的终止确认

1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

② 金融资产已转移，且该转移满足《企业会计准则第23号--金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

2) 当金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除时，相应终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，继续确认所转移的金融资产。公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：（1）未保留对该金融资产控制的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；（2）保留了对该金融资产控制的，按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）所转移金融资产在终止确认日的账面价值；（2）因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）之和。转移了金融资产的一部分，且该被转移部分整体满足终止确认条件的，将转移前金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和继续确认部分之间，按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）终止确认部分的账面价值；（2）终止确认部分的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）之和。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

（3）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。

(4) 对在交易所上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

(4) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、国债期货合约按照估值日的结算价估值；当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的结算价估值。

6、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 实收基金

每份基金份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的基金份额总额。

7.4.4.8 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。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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1.5%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、公休假等，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取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3. 按照国家有关规定可以列入的其他费用

本基金存续期间发生的信息披露费，与基金资产相关的会计师事务所审计费和律师费、基金资产终止时的清算费用以及按照管理合同及国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据其他相关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金资产费用。

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各纳税主体，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。

7.4.4.11 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。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

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

执行新金融工具准则导致的会计政策变更

财政部于2017年3月31日分别发布了《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量（2017年修订）》（财会〔2017〕7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移（2017年修订）》（财会〔2017〕8号）、《企业会计准则第24号—套期会计（2017年修订）》（财会〔2017〕9号），于2017年5月2日发布了《企业会计准则第37号—金融工具列报（2017年修订）》（财会〔2017〕14号）（上述准则统称“新金融工具准则”），要求境内上市企业自2019年1月1日起执行新金融工具准则。

经本基金管理人母公司浙商证券第三届董事会第五次会议决议通过，本公司于2019年1月1日起开始执行前述新金融工具准则。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
活期存款	12,257,720.31

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	12,257,720.31

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	136,605,090.70	158,380,842.36	21,775,751.66
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	136,605,090.70	158,380,842.36	21,775,751.66

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末，未持有衍生金融资产/负债。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度末数据。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度末数据。

7.4.7.4.2 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。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度末数据。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应收活期存款利息	923.45
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	203.39
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	42.90
合计	1,169.74

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。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末，未持有其他资产。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度末数据。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	355,386.68
银行间市场应付交易费用	-

合计	355,386.68
----	------------

本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度末数据。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,437.28
预提费用	142,500.00
合计	146,937.28

本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度末数据。

7.4.7.9 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12月31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	134,915,596.56	134,915,596.56
本期赎回（以“-”号填列）	-293,440,790.69	-293,440,790.69
本期末	126,453,865.70	126,453,865.70

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

2、本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。基金合同生效日的基金份额总额为284,979,059.83份基金份额，其中认购资金利息折合0份基金份额。

7.4.7.10 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	18,458,352.67	21,775,751.66	40,234,104.33
本期基金份额交易产	3,244,269.56	-682,297.73	2,561,971.83

生的变动数			
其中：基金申购款	15,247,953.67	5,874,340.22	21,122,293.89
基金赎回款	-12,003,684.11	-6,556,637.95	-18,560,322.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,702,622.23	21,093,453.93	42,796,076.16

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度同期对比数据。

7.4.7.11 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12月31日
活期存款利息收入	91,266.93
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	7,863.24
其他	797.30
合计	357,394.14

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度同期对比数据。

7.4.7.12 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12月31日
卖出股票成交总额	213,294,765.12
减：卖出股票成本总额	195,152,238.16
买卖股票差价收入	18,142,526.96

注：本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.13 基金投资收益

本基金在本报告期末进行基金投资。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 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12月31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

注：本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.14.2 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12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	85,668,717.89
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	2,941,998.71
买卖债券差价收入	-531,099.82

注：本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.14.3 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。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期未进行贵金属投资。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未进行权证投资。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未进行其他衍生工具投资。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.17 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12月31日
股票投资产生的股利收益	1,351,073.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,351,073.47

注：本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.18 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12月31日
1. 交易性金融资产	21,775,751.66
——股票投资	21,775,751.66
——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	21,775,751.66

注：本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.19 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12月31日
基金赎回费收入	1,014,981.12
合计	1,014,981.12

注：本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.20 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12月31日
交易所市场交易费用	703,628.71
银行间市场交易费用	-
合计	703,628.71

注：本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.21 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12月31日	
审计费用	42,500.00	
信息披露费	100,000.00	
汇划手续费	11,850.77	
合计	154,350.77	

注：本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
中国农业银行股份有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31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	356,933,636.61	67.04%

公司		
----	--	--

注：本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.3 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12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
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03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.4 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12月31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03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.5 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12月31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	261,024.60	67.40%	261,024.60	73.45%

注：本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,942,443.81
其中：支付销售机构的客户维护费	1,117,972.12

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03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.2.2 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12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	323,740.61

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03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未持有本基金。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.4.2 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03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.5 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12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	12,257,720.31	91,266.93

注：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。本基金的基金合同生效日为2019年03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.6 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未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03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.7 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03月25日，无上年度可比期间数据。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

7.4.12.2 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有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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。

7.4.13.2.1 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，本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.2.2 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，本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.2.3 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，本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.2.4 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，本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.2.5 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，本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.2.6 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，本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.3 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7.4.12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。

7.4.13.3.1 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	12,257,7 20.31	-	-	-	-	12,257,7 20.31
结算备付金	410,923. 86	-	-	-	-	410,923. 86
存出保证金	86,530.5 0	-	-	-	-	86,530.5 0
交易性金融 资产	158,380, 842.36	-	-	-	-	158,380, 842.36
资产总计	171,136, 017.03	0.00	0.00	0.00	0.00	171,136, 017.03
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	171,136,	0.00	0.00	0.00	0.00	171,136,

	017.03					017.03
--	--------	--	--	--	--	--------

注：本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.3.2 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，本基金未持有流通受限资产。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	12,257,720.31	-	-	-	-	-	12,257,720.31
结算备付金	410,923.86	-	-	-	-	-	410,923.86
存出保证金	86,530.50	-	-	-	-	-	86,530.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	158,380,842.36	158,380,842.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,733,027.17	1,733,027.17
应收利息	-	-	-	-	-	1,169.74	1,169.74
应收申购款	-	-	-	-	-	300,716.03	300,716.03
资产总计	12,755,174.67	-	-	-	-	160,415,755.30	173,170,929.97
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	3,166,411.23	3,166,411.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	216,216.78	216,216.78
应付托管费	-	-	-	-	-	36,036.14	36,036.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	355,386.68	355,386.68
其他负债	-	-	-	-	-	146,937.28	146,937.28
负债总计	-	-	-	-	-	3,920,988.11	3,920,988.11
利率敏感度缺口	12,755,174.67	-	-	-	-	156,494,767.19	169,249,941.86

注：1、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。

2、本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.4.1.2 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。本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	158,380,842.36	93.58
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	158,380,842.36	93.58

注：本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.4.3.2 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12月31日
	1、沪深300指数上涨5%	8,746,432.89
	2、沪深300指数下跌5%	-8,746,432.89

注：本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.13.4.4 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12月31日
	风险价值	-2,076,155.43

注：本基金自2019年3月25日起基金合同生效，上年度末数据无。

7.4.14 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。

§ 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	158,380,842.36	91.46
	其中：股票	158,380,842.36	91.46
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	12,668,644.17	7.32
8	其他各项资产	2,121,443.44	1.23
9	合计	173,170,929.97	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	6,403,050.00	3.78
C	制造业	85,161,583.77	50.32
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	4,982,238.00	2.94
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	5,968,110.00	3.53
J	金融业	42,014,051.00	24.82
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,647,144.55	3.93
M	科学研究和技术服务业	3,832,192.00	2.26
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,365,895.00	1.99
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	158,380,842.36	93.58

8.2.2 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投资组合。

8.3 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	601318	中国平安	112,200	9,588,612.00	5.67
2	601166	兴业银行	484,000	9,583,200.00	5.66
3	600887	伊利股份	267,900	8,288,826.00	4.90
4	600585	海螺水泥	138,800	7,606,240.00	4.49
5	300750	宁德时代	71,200	7,575,680.00	4.48
6	000333	美的集团	129,900	7,566,675.00	4.47
7	300618	寒锐钴业	89,500	7,373,905.00	4.36
8	600036	招商银行	181,000	6,801,980.00	4.02
9	601888	中国国旅	74,729	6,647,144.55	3.93
10	600276	恒瑞医药	73,527	6,435,083.04	3.80
11	601899	紫金矿业	1,395,000	6,403,050.00	3.78
12	002475	立讯精密	173,500	6,332,750.00	3.74
13	600030	中信证券	249,900	6,322,470.00	3.74
14	600309	万华化学	99,200	5,572,064.00	3.29
15	300760	迈瑞医疗	29,900	5,438,810.00	3.21
16	300783	三只松鼠	77,400	4,982,238.00	2.94
17	002624	完美世界	95,400	4,210,956.00	2.49
18	601066	中信建投	138,200	4,201,280.00	2.48
19	000001	平安银行	250,900	4,127,305.00	2.44
20	300014	亿纬锂能	76,400	3,832,224.00	2.26
21	603259	药明康德	41,600	3,832,192.00	2.26
22	600745	闻泰科技	39,900	3,690,750.00	2.18
23	600031	三一重工	214,200	3,652,110.00	2.16
24	300347	泰格医药	53,300	3,365,895.00	1.99
25	600600	青岛啤酒	58,300	2,973,300.00	1.76
26	000063	中兴通讯	64,400	2,279,116.00	1.35
27	603517	绝味食品	48,500	2,252,825.00	1.33
28	002466	天齐锂业	71,600	2,160,888.00	1.28
29	002812	恩捷股份	41,400	2,090,700.00	1.24
30	300253	卫宁健康	117,300	1,757,154.00	1.04
31	601688	华泰证券	68,400	1,389,204.00	0.82

32	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
33	603109	N神驰	684	18,105.48	0.01
34	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

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	17,094,452.70	10.10
2	601166	兴业银行	13,070,501.30	7.72
3	601888	中国国旅	12,194,305.87	7.20
4	600887	伊利股份	11,873,157.00	7.02
5	600036	招商银行	11,277,795.00	6.66
6	603019	中科曙光	9,991,557.40	5.90
7	603259	药明康德	9,479,717.00	5.60
8	601933	永辉超市	8,599,220.00	5.08
9	300618	寒锐钴业	8,486,664.70	5.01
10	600900	长江电力	8,327,502.52	4.92
11	600030	中信证券	8,077,810.89	4.77
12	000895	双汇发展	7,867,129.66	4.65
13	300760	迈瑞医疗	7,796,455.00	4.61
14	000333	美的集团	7,744,459.98	4.58
15	600019	宝钢股份	6,291,281.48	3.72
16	600585	海螺水泥	6,280,712.06	3.71
17	601688	华泰证券	6,129,638.00	3.62
18	300750	宁德时代	6,063,636.00	3.58
19	000063	中兴通讯	5,738,856.00	3.39
20	601668	中国建筑	5,597,760.00	3.31
21	600309	万华化学	5,284,997.20	3.12
22	601899	紫金矿业	5,222,786.83	3.09

23	600276	恒瑞医药	5,210,961.46	3.08
24	300783	三只松鼠	5,180,994.00	3.06
25	600031	三一重工	4,932,546.00	2.91
26	600271	航天信息	4,829,790.00	2.85
27	601919	中远海控	4,759,273.92	2.81
28	000963	华东医药	4,682,377.00	2.77
29	600519	贵州茅台	4,650,917.00	2.75
30	300413	芒果超媒	4,403,629.00	2.60
31	002555	三七互娱	4,370,083.84	2.58
32	002299	圣农发展	4,263,825.80	2.52
33	000001	平安银行	4,198,575.71	2.48
34	002475	立讯精密	4,025,323.00	2.38
35	002410	广联达	3,661,727.00	2.16
36	000661	长春高新	3,661,548.52	2.16
37	601939	建设银行	3,493,758.00	2.06

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	5.43
2	601318	中国平安	8,363,572.00	4.94
3	600900	长江电力	8,261,042.77	4.88
4	601933	永辉超市	7,918,724.00	4.68
5	000895	双汇发展	7,626,342.43	4.51
6	603259	药明康德	6,930,111.90	4.09
7	601888	中国国旅	6,648,845.92	3.93
8	600019	宝钢股份	6,328,631.00	3.74

9	601668	中国建筑	5,864,771.58	3.47
10	600036	招商银行	5,086,500.00	3.01
11	601919	中远海控	4,907,551.65	2.90
12	000661	长春高新	4,845,367.14	2.86
13	600271	航天信息	4,837,934.00	2.86
14	002555	三七互娱	4,762,148.00	2.81
15	600519	贵州茅台	4,690,010.00	2.77
16	601166	兴业银行	4,476,350.19	2.64
17	300413	芒果超媒	4,369,873.00	2.58
18	000963	华东医药	4,259,490.00	2.52
19	601688	华泰证券	4,018,602.00	2.37
20	300618	寒锐钴业	3,880,390.96	2.29
21	002410	广联达	3,667,415.00	2.17
22	600887	伊利股份	3,664,786.00	2.17
23	002299	圣农发展	3,636,617.96	2.15
24	601939	建设银行	3,484,080.00	2.06
25	600763	通策医疗	3,397,026.00	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	331,757,328.86
卖出股票收入（成交）总额	213,294,765.12

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。

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。

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

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 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。

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	86,530.50
2	应收证券清算款	1,733,027.17
3	应收股利	-
4	应收利息	1,169.74
5	应收申购款	300,716.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,121,443.44

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

本基金本报告期末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	持有份额	占总份

			额比例		额比例
1,665	75,948.27	65,872,092.82	52.00%	60,581,772.88	48.00%

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	68,913.90	0.0545%

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、基金投资和研发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，基金投资部门及研究部门负责人，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(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	134,915,596.56
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	293,440,790.69
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	126,453,865.70

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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：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。

2019年10月,路迹女士因工作调动,辞去副总经理职务。上述人事变动,已按相关规定备案、公告。

基金托管人的重大人事变动: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。上述人事变动,已按相关规定备案、公告。

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。上述人事变动,已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

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

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。

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	
长江证券	1	95,066,808.70	17.85%	67,621.02	17.46%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通	1	68,771,165.84	12.92%	50,292.35	12.99%	-

证券						
申万宏源	1	11,684,554.26	2.19%	8,311.78	2.15%	-
浙商证券	2	356,933,636.61	67.04%	261,024.60	67.40%	-

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，本公司新增1个长江证券交易单元，新增1个海通证券交易单元，新增1个申万宏源证券交易单元。

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
长江证券	-	-	50,000,000.00	8.93%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	50,000,000.00	8.93%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

浙商证券	107,664,990.50	100.00%	460,000,000.00	82.14%	-	-	-	-
------	----------------	---------	----------------	--------	---	---	---	---

11.8 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	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金风险评估报告	中国证监会指定媒介	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招募说明书	中国证监会指定媒介	2019-02-15
3	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	中国证监会指定媒介	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基金合同摘要	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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份额发售公告	中国证监会指定媒介	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同生效公告	中国证监会指定媒介	2019-03-26
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	中国证监会指定媒介	2019-04-12
10	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金参与浙	中国证监会指定媒介	2019-05-25

	商证券股份有限公司费率优惠活动的公告		
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江浙商证券资产管理有限公司直销费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	2019-05-25
13	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	中国证监会指定媒介	2019-05-25
14	关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下部分公募基金销售机构的公告	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	2019-06-29

	告		
20	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自然日净值公告	中国证监会指定媒介	2019-07-01
21	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自然日净值公告	中国证监会指定媒介	2019-07-01
22	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金2019年第二季度报告	中国证监会指定媒介	2019-07-19
23	浙江浙商证券资产管理有限公司关于开通旗下部分基金转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-07-25
24	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	中国证监会指定媒介	2019-08-26
25	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2019-08-26
26	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金2019年第三季度报告	中国证监会指定媒介	2019-10-24
27	浙江浙商证券资产管理有限公司副总经理离任公告	中国证监会指定媒介	2019-10-30
28	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告	中国证监会指定媒介	2019-11-15
29	浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金招募说	中国证监会指定媒介	2019-11-15

	明书（更新）（摘要）（2019年第1号）		
30	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（更新）（2019年第1号）	中国证监会指定媒介	2019-11-15
31	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	中国证监会指定媒介	2019-11-15
32	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	中国证监会指定媒介	2019-11-15

§ 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

根据中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，本公司于报告期内对基金合同、托管协议和招募说明书等法律文件进行了信息披露相关条款的修订。详情可见本基金管理人网站（www.stocke.com.cn）和中国证监会指定媒介刊登的法律文件及公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 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》；
报告期内在指定媒介上披露的各项公告；
基金管理人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

基金管理人住所及托管人住所。

13.3 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
二〇二〇年四月二十九日