

**浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金  
(LOF)**

**2020 年年度报告**

2020 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 03 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3月29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2020年01月01日起至2020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	7
§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	14
6.1 审计报告基本信息	14
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	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
8.12 投资组合报告附注.....	51
§9 基金份额持有人信息.....	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
9.4 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.....	52
§10 开放式基金份额变动.....	53
§11 重大事件揭示.....	53
11.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
11.4 基金投资策略的改变.....	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
11.8 其他重大事件.....	55
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§13 备查文件目录.....	58
13.1 备查文件目录.....	58
13.2 存放地点.....	58
13.3 查阅方式.....	58

## § 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	8,182,455.01份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
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</p>

	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。

### 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	0571-87903297
	电子邮箱	fund@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楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	310020	100140
法定代表人	盛建龙	陈四清

### 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(特殊普通合伙)	北京市西城区裕民路18号北环中心22层
注册登记机构	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

## § 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	2020年	2019年	2018年
本期已实现收益	4,145,273.47	5,762,336.52	13,923,990.82
本期利润	6,146,960.70	7,458,683.31	9,122,470.53
加权平均基金份额本期利润	0.3929	0.2451	0.0669
本期加权平均净值利润率	32.22%	23.10%	6.68%
本期基金份额净值增长率	52.90%	19.48%	-0.31%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	4,956,042.68	3,728,449.09	-3,799,842.01
期末可供分配基金份额利润	0.6057	0.1359	-0.0497
期末基金资产净值	14,495,651.01	31,795,387.18	74,128,358.17
期末基金份额净值	1.7716	1.1587	0.9698
3.1.3 累计期末指标	2020年末	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	77.16%	15.87%	-3.02%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	25.67%	1.60%	9.74%	0.69%	15.93%	0.91%
过去六个月	49.30%	1.80%	16.96%	0.93%	32.34%	0.87%
过去一年	52.90%	1.92%	18.98%	0.99%	33.92%	0.93%
过去三年	82.11%	1.27%	24.04%	0.93%	58.07%	0.34%
自基金合同生效起至今	77.16%	1.11%	35.71%	0.83%	41.45%	0.28%

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%。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70%、30%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

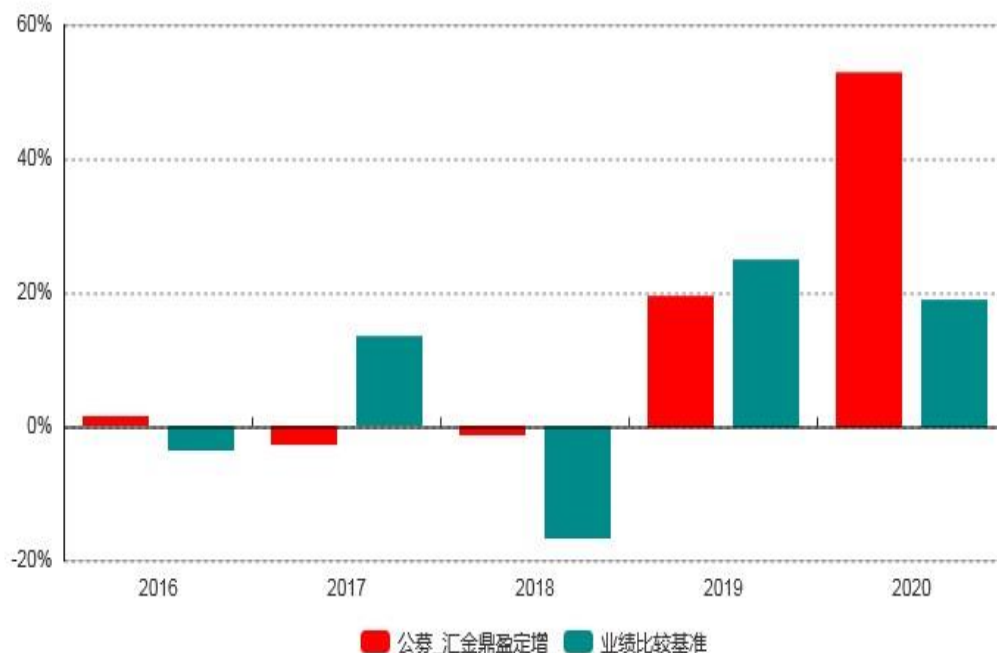
浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年12月07日-2020年12月31日)





### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为2016年12月7日，基金合同生效当年的相关数据和指标按实际存续期计算，不按照整个自然年度计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年，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2020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、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、浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金、浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚泓两年定期开放债券型发起式证券投资基金和浙商汇金安享66个月定期开放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基金、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	2018- 04-19	-	9 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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金基金经理未存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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

2020年新冠疫情席卷全球，全球资本市场演绎大致呈现了先抑后扬的走势。面对汹涌而来的疫情，主要经济体作出了不同的应对策略，从而引发了全球产业链的重塑和供需格局的调整。中国首先从疫情中走出，复工复产驱动经济持续修复，同时由于海外大规模货币财政刺激带来了实物商品需求的溢出，中国出口持续超预期，成为驱动下半年资源品、制造业行情的重要因素。全年看，沪深300上涨27.2%，本基金累积净值增长52.9%。

在策略判断上，2020年我们始终认为A股市场仍会呈现结构性行情，且在产业升级以及注册制背景下，具备真实成长性的优秀公司将是很长时间内市场追捧的对象；上半年在疫情持续发酵背景下，医药、必选消费领涨市场，而下半年随着工业修复、出口好转，制造业，特别是先进制造业成为市场焦点，我们也是沿着这一思路，下半年在此前持仓的基础上继续深挖制造业中具备全球竞争力的龙头品种，并从景气度和长期空间出发，超配了代表未来产业方向的新能源汽车和光伏等行业。

#### 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1.7716元，本报告期内，基金份额净值增长率为52.90%，同期业绩比较基准收益率为18.98%。

### 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2021年，新冠疫情的走势仍是影响市场的关键变量，随着疫苗的普及，全球将迎来共振复苏，近期上游大宗商品的大幅上涨引发市场对于未来通胀的担忧，我们对此会保持关注。我们相信，人类终将战胜疫情，产业升级和消费迭代升级仍是社会发展的大趋势，中长期看先进制造业和泛消费品仍将是中國资本市场的主要赛道，同时后疫情时代全球供应链格局亦将发生深刻变化，人们的生产生活方式也会随着长期改变，我们

会紧密跟踪相关行业的动态，勤勉尽责，努力发掘投资机遇，争取为投资者创造持续的超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020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，本基金于2020年01月01日至2020年12月31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 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，本基金托管人在对浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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，浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的管理人——浙商资产管理有限公司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)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

#### 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

本托管人依法对浙商资产管理有限公司编制和披露的浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2020年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 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	[2021]京会兴审字第04030006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	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)份额持有人
审计意见	我们认为，浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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》、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，公允反映了浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2020年12月31日的财务状况以及2020年度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，我们独立于浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)，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	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的基金管理人浙江浙商证券资产管理

	<p>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。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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。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:(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。(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。(三)评价基金管理人管</p>



	<p>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。（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，就可能对浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)不能持续经营。（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。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	孙建	宜军民
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	2021-03-18	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,482,880.66	3,867,152.66

结算备付金		8,125.91	127,647.41
存出保证金		4,873.44	7,778.23
交易性金融资产	7.4.7.2	12,893,689.00	28,597,482.50
其中：股票投资		12,893,689.00	28,597,482.50
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		500,171.73	-
应收利息	7.4.7.5	6.00	754.65
应收股利		-	-
应收申购款		3,952.57	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		14,893,699.31	32,600,815.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	479,345.20
应付管理人报酬		17,672.55	40,503.63
应付托管费		2,945.43	6,750.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	204,928.35	156,327.97

应交税费		1.97	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	172,500.00	122,500.86
负债合计		398,048.30	805,428.27
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	8,182,455.01	27,440,364.98
未分配利润	7.4.7.10	6,313,196.00	4,355,022.20
所有者权益合计		14,495,651.01	31,795,387.18
负债和所有者权益总计		14,893,699.31	32,600,815.45

注：报告截止日2020年12月31日，基金份额净值1.7716元，基金份额总额10,769,117.59份。

## 7.2 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：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
<b>一、收入</b>		6,841,196.42	8,572,765.05
1. 利息收入		16,163.82	125,807.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	16,044.08	86,427.15
债券利息收入		4.44	11.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		115.30	39,369.39
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,789,736.43	6,666,223.91
其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,684,111.03	6,422,648.86
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	16,804.55	6,850.16
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	88,820.85	236,724.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,001,687.23	1,696,346.79
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	33,608.94	84,386.38
<b>减：二、费用</b>		694,235.72	1,114,081.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	288,821.79	487,009.22
2. 托管费	7.4.10.2. 2	48,136.98	81,168.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	200,734.88	358,746.66
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		0.41	141.72
7. 其他费用	7.4.7.21	156,541.66	187,015.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,146,960.70	7,458,683.31
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		6,146,960.70	7,458,683.31

号填列)			
------	--	--	--

### 7.3 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：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020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)	27,440,364.98	4,355,022.20	31,795,387.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,146,960.70	6,146,960.70
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)	-19,257,909.97	-4,188,786.90	-23,446,696.87
其中：1. 基金申购款	2,732,667.77	895,110.98	3,627,778.75
2. 基金赎回款	-21,990,577.74	-5,083,897.88	-27,074,475.62
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)	8,182,455.01	6,313,196.00	14,495,651.01
项 目	上年度可比期间 2019年01月01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)	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)	-	7,458,683.31	7,458,683.31
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)	-48,993,100.28	-798,554.02	-49,791,654.30
其中：1. 基金申购款	18,119,820.00	1,629,511.32	19,749,331.32
2. 基金赎回款	-67,112,920.28	-2,428,065.34	-69,540,985.62
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)	27,440,364.98	4,355,022.20	31,795,387.18

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

浙商汇金鼎盈事件驱动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，基金合同生效后，本基金设一个18个月的封闭期，在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额；封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金，并更名为浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF），投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。存续期为不定期。自2018年6月7日起，本基金转换为上市开放式基金（LOF），由原来“浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”名称变更为“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。

#### 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《浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定而编制的。

本财务报表以持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2020年12月31日的财务状况以及2020年年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。



(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

#### 7.4.7 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	1,482,880.66	3,867,152.66
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	1,482,880.66	3,867,152.66

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,167,155.58	12,893,689.00	3,726,533.42
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	9,167,155.58	12,893,689.00	3,726,533.42

项目	上年度末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	26,872,636.31	28,597,482.50	1,724,846.19
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	26,872,636.31	28,597,482.50	1,724,846.19

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末，均未持有衍生金融资产/负债。

#### 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及上年度末，均未持有买入返售金融资产。

##### 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及上年度末，均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	180.47	688.10
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	3.52	62.70
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	-180.41	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	2.42	3.85
合计	6.00	754.65

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末，均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	204,928.35	156,327.97
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	204,928.35	156,327.97

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	0.86
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	172,500.00	122,500.00
合计	172,500.00	122,500.86

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日
----	---------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,440,364.98	27,440,364.98
本期申购	2,732,667.77	2,732,667.77
本期赎回（以“-”号填列）	-21,990,577.74	-21,990,577.74
本期末	8,182,455.01	8,182,455.01

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

#### 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
上年度末	3,728,449.09	626,573.11	4,355,022.20
本期利润	4,145,273.47	2,001,687.23	6,146,960.70
本期基金份额交易产生的变动数	-2,917,679.88	-1,271,107.02	-4,188,786.90
其中：基金申购款	745,885.27	149,225.71	895,110.98
基金赎回款	-3,663,565.15	-1,420,332.73	-5,083,897.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,956,042.68	1,357,153.32	6,313,196.00

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	15,177.64	81,348.74
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	702.68	4,552.62
其他	163.76	525.79
合计	16,044.08	86,427.15

#### 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 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	78,073,787.03	119,628,923.50
减：卖出股票成本总额	73,389,676.00	113,206,274.64
买卖股票差价收入	4,684,111.03	6,422,648.86

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金在本报告期及上年度可比期间未进行基金投资。

#### 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 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01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	16,804.55	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	16,804.55	6,850.16

##### 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 2020年01月01日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年01月01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	51,809.00	54,861.60

减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	35,000.00	48,000.00
减：应收利息总额	4.45	11.44
买卖债券差价收入	16,804.55	6,850.16

#### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未进行资产支持证券投资。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未进行贵金属投资。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未进行权证投资。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未进行其他衍生工具投资。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
股票投资产生的股利收益	88,820.85	236,724.89
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	88,820.85	236,724.89

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	2,001,687.23	1,696,346.79
——股票投资	2,001,687.23	1,696,346.79
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	2,001,687.23	1,696,346.79

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
基金赎回费收入	33,608.94	84,386.38
合计	33,608.94	84,386.38

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	200,734.88	358,746.66
银行间市场交易费用	-	-
合计	200,734.88	358,746.66

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	42,500.00	42,500.00
信息披露费	50,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	388.00	549.00
中登认购登记结算费	3,653.66	3,966.96
其他	60,000.00	60,000.00
合计	156,541.66	187,015.96

#### 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
浙商期货有限公司	受基金管理人母公司控制的公司

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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
浙商证券 股份有限 公司	64,881,259.78	48.51%	145,907,468.45	56.95%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
浙商证券 股份有限 公司	51,809.00	100.00%	18,343.90	33.44%

#### 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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的

		比例		比例
浙商证券股份有限公司	1,600,000.00	100.00%	49,000,000.00	100.00%

#### 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 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
浙商证券股份有限公司	60,433.93	54.55%	2,213.51	1.08%
关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
浙商证券股份有限公司	135,886.39	62.80%	3,974.37	2.54%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	288,821.79	487,009.22
其中：支付销售机构的客户维护费	27,470.16	54,952.18

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	48,136.98	81,168.18

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未持有本基金。

**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**

本报告期末及上年度末未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。

**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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,482,880.66	15,177.64	3,867,152.66	81,348.74

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。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券的情况。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于浙商期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金不计息，存出保证金不计息。于2019年12月31日，本基金的结算备付金余额为1001.00元，无存出保证金余额。于2020年12月31日，本基金的结算备付金余额为1001.00元，无存出保证金余额。

**7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金**

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（2020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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**7.4.12.2 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2020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2020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

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。

公司目前的组织架构体系主要有五个层次:一是董事会及专门委员会的风险管理战略性安排,以及监事的监督检查;二是经理层、经理层下设业务委员会的风险管理决策;三是风险管理部门的风控制衡;四是业务部门及业务立项委员会、产品设计委员会的直接管理;五是合规风控专员在业务部门内部的风控制衡。各风险管理层级按照公司《全面风险管理办法》要求在各自职责范围内履行风险管理职责。业务部门、风险管理部门、审计稽核部门共同构成了风险管理三道防线,实施事前、事中与事后的风险防范、监控与评价工作。

#### 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工商银行,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

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

**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 2020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	1,482,88 0.66	-	-	-	-	1,482,88 0.66
结算备付金	8,125.91	-	-	-	-	8,125.91
存出保证金	4,873.44	-	-	-	-	4,873.44
交易性金融 资产	12,893,6 89.00	-	-	-	-	12,893,6 89.00
资产总计	14,389,5 69.01	-	-	-	-	14,389,5 69.01
负债	-	-	-	-	-	

负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	14,389,569.01	-	-	-	-	14,389,569.01
上年度末 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	3,867,152.66	-	-	-	-	3,867,152.66
结算备付金	127,647.41	-	-	-	-	127,647.41
存出保证金	7,778.23	-	-	-	-	7,778.23
交易性金融 资产	28,597,482.50	-	-	-	-	28,597,482.50
资产总计	32,600,060.80	0.00	0.00	0.00	0.00	32,600,060.80
负债	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	32,600,060.80	0.00	0.00	0.00	0.00	32,600,060.80

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的合规风控部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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 2020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	1,482,880.66	-	-	-	-	-	1,482,880.66
结算备付金	8,125.91	-	-	-	-	-	8,125.91
存出保证金	4,873.44	-	-	-	-	-	4,873.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	12,893,689.00	12,893,689.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	500,171.73	500,171.73
应收利息	-	-	-	-	-	6.00	6.00
应收申购款	-	-	-	-	-	3,952.57	3,952.57
资产总计	1,495,880.01	-	-	-	-	13,397,819.30	14,893,699.31
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,672.55	17,672.55
应付托管费	-	-	-	-	-	2,945.43	2,945.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	204,928.35	204,928.35
应交税费	-	-	-	-	-	1.97	1.97
其他负债	-	-	-	-	-	172,500.00	172,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	398,048.30	398,048.30
利率敏感度缺	1,495,880.01	-	-	-	-	12,999,771.00	14,495,651.01



口							
上年度末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	3,867,152.66	-	-	-	-	-	3,867,152.66
结算备付金	127,647.41	-	-	-	-	-	127,647.41
存出保证金	7,778.23	-	-	-	-	-	7,778.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	28,597,482.50	28,597,482.50
应收利息	-	-	-	-	-	754.65	754.65
资产总计	4,002,578.30	-	-	-	-	28,598,237.15	32,600,815.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	479,345.20	479,345.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,503.63	40,503.63
应付托管费	-	-	-	-	-	6,750.61	6,750.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	156,327.97	156,327.97
其他负债	-	-	-	-	-	122,500.86	122,500.86
负债总计	-	-	-	-	-	805,428.27	805,428.27
利率敏感度缺口	4,002,578.30	-	-	-	-	27,792,808.88	31,795,387.18

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

#### 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 2020年12月31日		上年度末 2019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	12,893,689.00	88.95	28,597,482.50	89.94
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	12,893,689.00	88.95	28,597,482.50	89.94

##### 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	1、沪深300指数上涨5%	780,485.22	1,115,759.92
	2、沪深300指数下跌5%	-780,485.22	-1,115,759.92

#### 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	风险价值	-332,938.01	-386,153.39
	合计	-332,938.01	-386,153.39

#### 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	12,893,689.00	86.57
	其中：股票	12,893,689.00	86.57
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	1,491,006.57	10.01
8	其他各项资产	509,003.74	3.42
9	合计	14,893,699.31	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	735,768.00	5.08
C	制造业	10,539,969.00	72.71
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	-	-
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	514,800.00	3.55
J	金融业	618,880.00	4.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	484,272.00	3.34
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,893,689.00	88.95

### 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	300750	宁德时代	2,700	947,997.00	6.54
2	600438	通威股份	21,800	837,992.00	5.78
3	300450	先导智能	9,500	797,905.00	5.50
4	601899	紫金矿业	79,200	735,768.00	5.08
5	300124	汇川技术	7,800	727,740.00	5.02
6	600703	三安光电	26,900	726,569.00	5.01
7	300747	锐科激光	7,850	689,701.00	4.76
8	000661	长春高新	1,400	628,474.00	4.34
9	000001	平安银行	32,000	618,880.00	4.27
10	600426	华鲁恒升	15,100	563,230.00	3.89
11	000725	京东方A	92,600	555,600.00	3.83
12	300496	中科创达	4,400	514,800.00	3.55
13	002709	天赐材料	4,900	508,620.00	3.51
14	603501	韦尔股份	2,200	508,420.00	3.51
15	600276	恒瑞医药	4,500	501,570.00	3.46
16	002466	天齐锂业	12,400	486,948.00	3.36
17	002127	南极电商	35,400	484,272.00	3.34
18	600887	伊利股份	10,800	479,196.00	3.31

19	300316	晶盛机电	15,100	454,208.00	3.13
20	002600	领益智造	37,600	450,824.00	3.11
21	300073	当升科技	6,400	415,040.00	2.86
22	600872	中炬高新	3,900	259,935.00	1.79

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000977	浪潮信息	2,858,499.16	8.99
2	300073	当升科技	2,303,841.97	7.25
3	002709	天赐材料	2,174,436.40	6.84
4	000725	京东方A	1,556,201.00	4.89
5	600584	长电科技	1,478,362.00	4.65
6	601288	农业银行	1,469,132.00	4.62
7	002007	华兰生物	1,422,816.50	4.47
8	002705	新宝股份	1,388,243.22	4.37
9	600438	通威股份	1,362,269.00	4.28
10	300769	德方纳米	1,348,806.80	4.24
11	300750	宁德时代	1,287,056.00	4.05
12	600161	天坛生物	1,250,284.89	3.93
13	002466	天齐锂业	1,126,622.00	3.54
14	300496	中科创达	1,071,215.00	3.37
15	601939	建设银行	1,058,658.00	3.33
16	601988	中国银行	987,694.00	3.11
17	002384	东山精密	967,900.00	3.04
18	600703	三安光电	966,828.00	3.04
19	600036	招商银行	938,938.00	2.95
20	601601	中国太保	867,933.00	2.73
21	600872	中炬高新	851,406.00	2.68

22	600741	华域汽车	816,472.00	2.57
23	002460	赣锋锂业	811,873.00	2.55
24	300078	思创医惠	810,487.85	2.55
25	600183	生益科技	810,439.00	2.55
26	600110	诺德股份	806,207.00	2.54
27	002594	比亚迪	804,000.00	2.53
28	603444	吉比特	799,951.00	2.52
29	300413	芒果超媒	779,822.00	2.45
30	600699	均胜电子	748,490.00	2.35
31	300014	亿纬锂能	743,534.00	2.34
32	300244	迪安诊断	735,546.00	2.31
33	300450	先导智能	734,515.00	2.31
34	300253	卫宁健康	731,967.00	2.30
35	603882	金域医学	726,050.00	2.28
36	300088	长信科技	722,370.00	2.27
37	002156	通富微电	718,272.00	2.26
38	002127	南极电商	711,786.00	2.24
39	000596	古井贡酒	686,947.00	2.16
40	000400	许继电气	684,489.00	2.15
41	300760	迈瑞医疗	657,865.00	2.07
42	300294	博雅生物	650,462.42	2.05
43	603993	洛阳钼业	641,240.00	2.02
44	300383	光环新网	638,185.00	2.01

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

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	601288	农业银行	3,887,287.00	12.23
2	601939	建设银行	3,408,005.89	10.72
3	002709	天赐材料	2,983,972.00	9.38
4	600584	长电科技	2,834,551.00	8.91
5	000977	浪潮信息	2,762,599.31	8.69
6	600028	中国石化	2,394,800.22	7.53
7	300073	当升科技	2,230,584.00	7.02
8	601988	中国银行	2,223,396.00	6.99
9	601166	兴业银行	2,215,943.00	6.97
10	002705	新宝股份	1,842,435.00	5.79
11	600887	伊利股份	1,653,400.00	5.20
12	600438	通威股份	1,588,607.37	5.00
13	600161	天坛生物	1,566,063.80	4.93
14	002466	天齐锂业	1,524,322.40	4.79
15	601328	交通银行	1,512,742.00	4.76
16	603993	洛阳钼业	1,466,592.00	4.61
17	300750	宁德时代	1,431,726.00	4.50
18	601899	紫金矿业	1,412,223.00	4.44
19	002007	华兰生物	1,399,052.45	4.40
20	601006	大秦铁路	1,292,022.00	4.06
21	300769	德方纳米	1,279,453.40	4.02
22	600104	上汽集团	1,269,828.00	3.99
23	601818	光大银行	1,268,250.00	3.99
24	601088	中国神华	1,170,720.00	3.68
25	000725	京东方A	1,156,677.00	3.64
26	601668	中国建筑	1,132,644.71	3.56
27	300253	卫宁健康	1,044,669.00	3.29
28	002460	赣锋锂业	1,043,480.00	3.28
29	002241	歌尔股份	1,039,013.00	3.27
30	300496	中科创达	1,005,104.00	3.16
31	600036	招商银行	977,165.00	3.07



32	603444	吉比特	940,780.00	2.96
33	002384	东山精密	933,720.00	2.94
34	600741	华域汽车	915,462.00	2.88
35	300618	寒锐钴业	909,538.00	2.86
36	002594	比亚迪	901,096.00	2.83
37	603882	金域医学	889,032.00	2.80
38	300760	迈瑞医疗	862,081.00	2.71
39	300014	亿纬锂能	853,848.00	2.69
40	600872	中炬高新	850,565.00	2.68
41	002624	完美世界	847,860.00	2.67
42	600183	生益科技	808,281.00	2.54
43	300088	长信科技	771,955.00	2.43
44	601601	中国太保	739,934.00	2.33
45	300413	芒果超媒	738,792.00	2.32
46	600885	宏发股份	712,754.00	2.24
47	300078	思创医惠	703,736.00	2.21
48	300383	光环新网	690,912.00	2.17
49	600585	海螺水泥	689,717.03	2.17
50	600110	诺德股份	668,891.00	2.10
51	300244	迪安诊断	636,167.24	2.00

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	55,684,195.27
卖出股票收入（成交）总额	78,073,787.03

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中平安银行于2020年2月3日、10月27日因未依法履行其他职责受到中国银行业监督管理委员会深圳监管局及宁波监管局公开处罚，共计罚款820万人民币。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。

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	4,873.44
2	应收证券清算款	500,171.73
3	应收股利	-
4	应收利息	6.00
5	应收申购款	3,952.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	509,003.74

### 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 额比例	持有份额	占总份 额比例
209	39,150.50	35,200.00	0.00%	8,147,255.01	100.00%

### 9.2 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	张海洲	687,058.19	8.40
2	洪忠华	593,128.38	7.25
3	仇庆松	494,273.65	6.04
4	徐江华	494,161.15	6.04
5	阮剑波	494,138.65	6.04
6	傅正平	366,306.00	4.48
7	路希逵	296,658.69	3.63
8	魏道榕	227,314.13	2.78
9	张文俊	204,031.00	2.49
10	郑权	200,007.00	2.44

### 9.3 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	108,714.55	1.3286%

### 9.4 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本报告期末未持有本基金;
- 2、本基金的基金经理本报告期末未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位: 份

基金合同生效日(2016年12月07日)基金份额总额	227,360,148.23
本报告期期初基金份额总额	27,440,364.98
本报告期基金总申购份额	2,732,667.77
减:本报告期基金总赎回份额	21,990,577.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,182,455.01

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

本报告期内,基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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	
国泰君安	1	68,865,107.12	51.49%	50,361.24	45.45%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	64,881,259.78	48.51%	60,433.93	54.55%	-

注：a)截至报告期末，本公司已在上海交易所、深圳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，本基金交易单元无变更。

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

- 1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	51,809.00	100.00%	1,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下基金2019年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-01-18
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)2019年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2020-01-18
3	关于增加大连网金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	中国证监会规定媒介	2020-03-18
4	浙江浙商证券资产管理有限公司关于延迟披露旗下基金2019年年度报告的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-26
5	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在大连网金基金销售有限公司开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-26
6	浙江浙商证券资产管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-31

7	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下基金2020年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-04-21
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)2020年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2020-04-21
9	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年年度报告	中国证监会规定媒介	2020-04-29
10	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下基金2019年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-04-29
11	关于浙江浙商证券资产管理有限公司旗下部分基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2020-05-30
12	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下部分基金2020年第二季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-07-18
13	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2020年第二季度报告	中国证监会规定媒介	2020-07-18
14	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下部分基金2020年中期报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-08-29
15	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2020年中期报告	中国证监会规定媒介	2020-08-29
16	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2020-09-01
17	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与	中国证监会规定媒介	2020-09-15



	江苏汇林保大基金销售有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告		
18	浙江浙商证券资产管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-10-19
19	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下部分基金2020年第三季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-27
20	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2020年第三季度报告	中国证监会规定媒介	2020-10-27
21	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)(2020年定期更新)	中国证监会规定媒介	2020-11-14
22	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2020-11-14
23	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与民商基金销售(上海)有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-31
24	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与北京植信基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-31

## § 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

投资	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序	持有基金份额比	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

者类别	号	例达到或者超过20%的时间区间					
	个人	-	20200101-20200705	9,136,434.26	0.00	9,136,434.26	0.00
产品特有风险							
报告期内，本基金单一客户持有份额比例超过基金总份额的20%，除本基金招募说明书中列示的各项风险情形外，还包括因该类投资者巨额赎回可能导致的基金清盘风险、流动性风险和基金净值波动风险。							

注:1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、场内买入份额和红利再投;  
2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额和场内卖出份额。

## 12.2 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。

## § 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;  
《浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;  
《浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;  
报告期内在规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、托管人住所及深圳证券交易所。

### 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](http://www.stocke.com.cn)。

浙江浙商证券资产管理有限公司  
二〇二一年三月三十日