

浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券
投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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、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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
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	13
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的真实、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	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	55

8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61
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	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 本报告期投资基金情况	62
8.13 投资组合报告附注	62
§ 9 基金份额持有人信息	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	64
§ 10 开放式基金份额变动	64
§ 11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	65
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.9 其他重大事件	68
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	70
13.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	浙商大数据智选消费	
基金主代码	002967	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年1月11日	
基金管理人	浙商基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	168,959,400.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C
下属分级基金的交易代码	002967	014813
报告期末下属分级基金的份额总额	168,765,378.07 份	194,021.93 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过公司自主研发的大数据智选模型进行行业配置和个股选择，在严格控制风险的前提下，力争获取较好的收益。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，在科学分析与有效管理风险的基础上，实现风险与收益的最佳匹配。
业绩比较基准	中证主要消费行业指数×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，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	浙商基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@cgb.com
客户服务电话	4000-679-908/021-60359000	021-60637228
传真	0571-28191919	021-60635778
注册地址	浙江省杭州市下城区环城北路208号1801室	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴西路99号万向大厦10楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码	310012	100033
法定代表人	肖风	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 2 幢 25 楼
注册登记机构	浙商基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 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

	2023 年		2022 年	2022 年 3 月 2 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	2021 年	
	3.1.1 期间数据和指标	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C	浙商大数据智选消费 A
本期已实现收益	-24,138,288.04	-30,006.00	-106,274,850.99	-75,143.84	96,761,340.19	-

本期利润	-41,859,738.25	-30,462.50	-138,943,005.89	-52,349.83	-3,699,773.50	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2199	-0.1799	-0.6089	-0.3713	-0.0156	-
本期加权平均净值利润率	-11.58%	-9.67%	-29.18%	-18.81%	-0.62%	-
本期基金份额净值增长率	-12.28%	-13.01%	-23.44%	-15.34%	-0.74%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	87,259,189.82	95,860.00	146,115,079.22	166,355.22	267,997,811.31	-
期末可供分配基金份额利润	0.5170	0.4941	0.6641	0.6544	1.1301	-
期末基金资产净值	288,211,419.03	326,905.40	428,470,735.10	492,434.07	603,098,369.91	-
期末基金份额净值	1.708	1.685	1.947	1.937	2.543	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	70.80%	-26.35%	94.70%	-15.34%	154.30%	-

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

浙商大数据智选消费 A

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	-5.16%	0.86%	-3.28%	0.63%	-1.88%	0.23%
过去六个月	-12.77%	0.80%	-3.97%	0.63%	-8.80%	0.17%
过去一年	-12.28%	0.89%	-10.39%	0.65%	-1.89%	0.24%
过去三年	-33.33%	1.27%	-18.64%	0.91%	-14.69%	0.36%
过去五年	84.05%	1.31%	58.32%	0.94%	25.73%	0.37%
自基金合同生效之日起至今	70.80%	1.20%	81.20%	0.94%	-10.40%	0.26%

浙商大数据智选消费 C

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

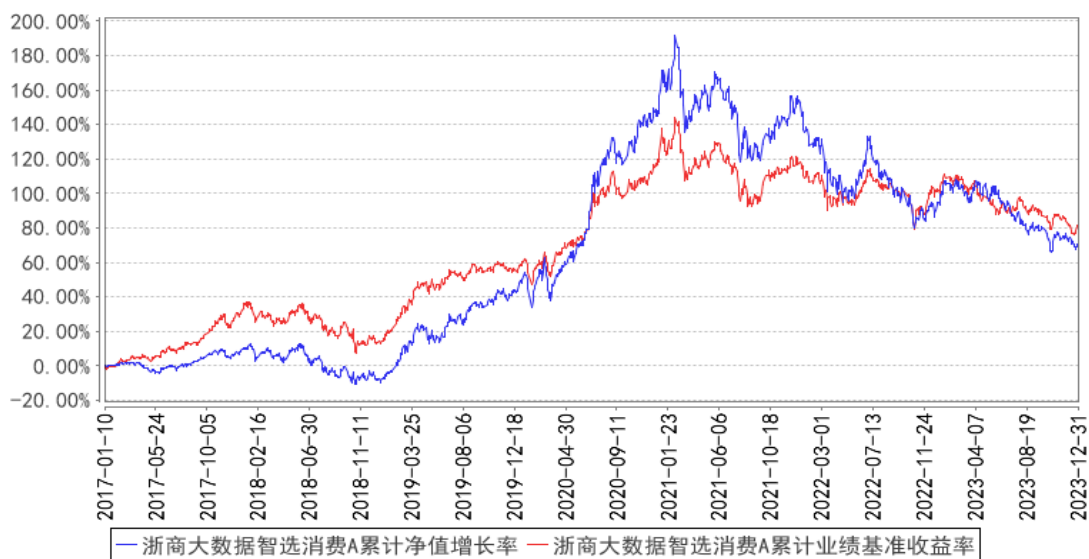
	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	-5.39%	0.86%	-3.28%	0.63%	-2.11%	0.23%
过去六个月	-13.10%	0.80%	-3.97%	0.63%	-9.13%	0.17%
过去一年	-13.01%	0.89%	-10.39%	0.65%	-2.62%	0.24%
自基金合同生效 起至今	-26.35%	1.17%	-13.81%	0.80%	-12.54%	0.37%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证主要消费行业指数×60%+上证国债指数收益率×40%

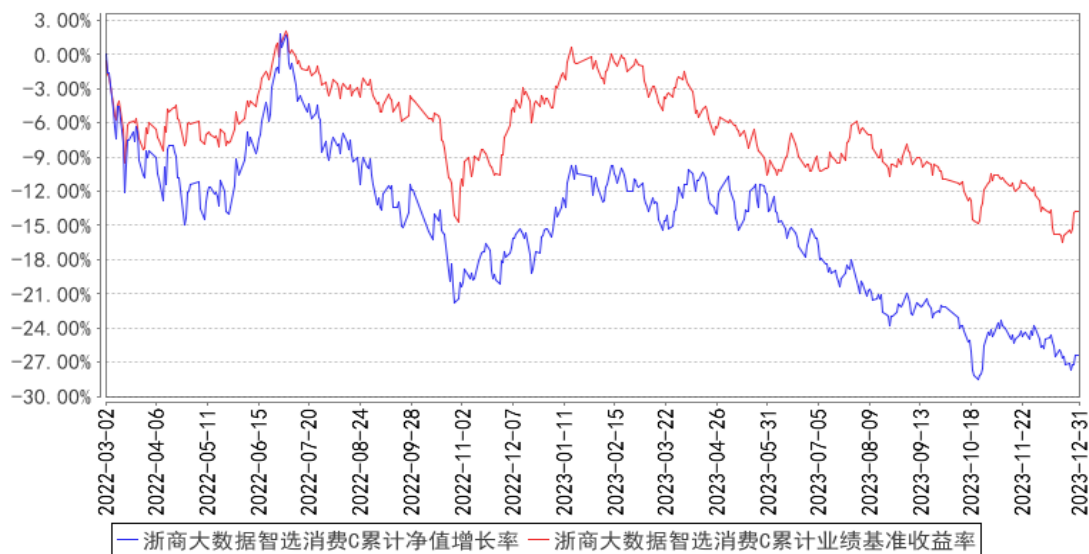
2、本基金于 2022 年 3 月 2 日起新增 C 类份额。

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

浙商大数据智选消费A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浙商大数据智选消费C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



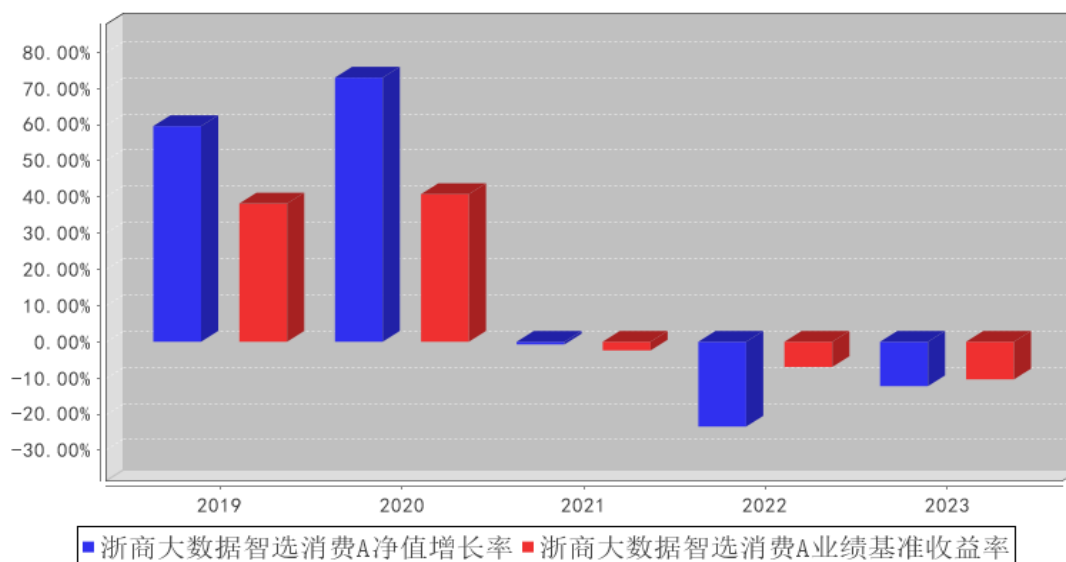
注：1、本基金基金合同生效日为 2017 年 1 月 11 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间已满一年。

2、本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

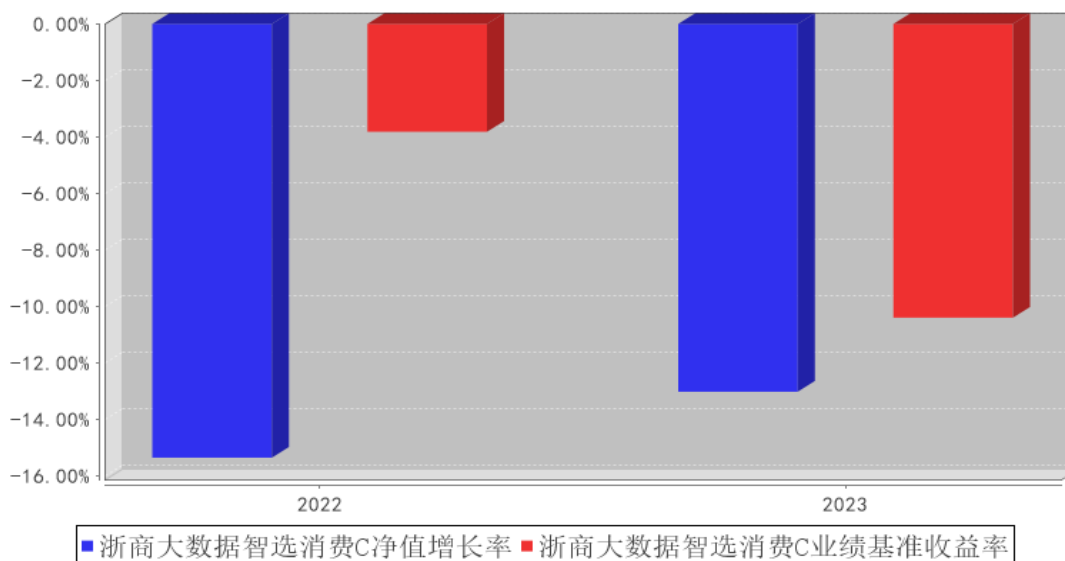
3、本基金自 2022 年 3 月 2 日起增设 C 类份额。

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

浙商大数据智选消费A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



浙商大数据智选消费C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金在过去三年内未进行过利润分配。

§ 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

浙商基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会(证监许可[2010]1312号)批准,于2010年10月21日成立。公司股东为民生人寿保险股份有限公司、浙商证券股份有限公司、养生堂有限公司。民生人寿保险股份有限公司出资15000万元,浙商证券股份有限公司和养生堂有限公司各出资7500万元,注册资本3亿元人民币。注册地为浙江省杭州市。

截至2023年12月31日,浙商基金共管理四十三只开放式基金——浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、浙商日添利货币市场基金、浙商惠丰定期开放债券型证券投资基金、浙商惠利纯债债券型证券投资基金、浙商惠裕纯债债券型证券投资基金、浙商惠南纯债债券型证券投资基金、浙商日添金货币市场基金、浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚盈纯债债券型证券投资基金、浙商全景消费混合型证券投资基金、浙商沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、浙商丰利增强债券型证券投资基金、浙商兴永纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商中证500指数增强型证券投资基金、浙商沪港深精选混合型证券投资基金、浙商智能行业优选混合型发起式证券投资基金、浙商港股通中华

交易服务预期高股息指数增强型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、浙商丰顺纯债债券型证券投资基金、浙商丰裕纯债债券型证券投资基金、浙商惠泉 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浙商惠睿纯债债券型证券投资基金、浙商智多兴稳健回报一年持有期混合型证券投资基金、浙商智多宝稳健一年持有期混合型证券投资基金、浙商中短债债券型证券投资基金、浙商惠隆 39 个月定期开放债券型证券投资基金、浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金、浙商智选领航三年持有期混合型证券投资基金、浙商智选经济动能混合型证券投资基金、浙商智选食品饮料股票型发起式证券投资基金、浙商智选家居股票型发起式证券投资基金、浙商创业板指数增强型发起式证券投资基金、浙商智选价值混合型证券投资基金、浙商智多金稳健一年持有期混合型证券投资基金、浙商智多享稳健混合型发起式证券投资基金、浙商智选先锋一年持有期混合型证券投资基金、浙商兴盛一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商智多盈债券型证券投资基金、浙商智选新兴产业混合型证券投资基金、浙商智配瑞享一年持有期债券型基金中基金（FOF）、浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金、浙商兴盈 6 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		
白玉	本基金的基金经理，公司智能权益投资部基金经理	2022 年 1 月 13 日	-	17 年	白玉女士，英国雷丁大学国际证券、投资和银行学硕士，历任北京兴华会计师事务所审计助理、万家基金管理有限公司研究员。

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

注：本报告期本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

为了规范公平交易行为，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规规定，本公司制定了相应的公平交易制度。在投资决策层面，本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，对不同类别的投资组合分别管理、独立决策；在交易层面，实行集中交易制度，建立了公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会，严禁在不同投资组合之间进行利益输送；在监控和评估层面，本公司金融工程小组将每日审查当天的投资交易，对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

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

2023 年国内经济的复苏进程一波三折，CPI 与 PPI 转负，PMI 落在收缩区间，这表明有效需求不足，部分行业产能过剩和社会预期偏弱的问题仍然存在。由于消费的复苏进度慢于预期，同时估值相对其他行业偏高，消费板块的跌幅高于市场整体跌幅。

本年度我们对消费内部进行了一些公司的调仓，主要是基于公司应对行业困难时的表现优劣以及需求的刚性程度。在大消费领域中，我们认为受宏观影响较弱的医药行业确定性更强，也做了重点配置。3 季度的医疗领域反腐短期虽然会对医药企业的经营节奏产生影响，但目前看影响相对可控，市场也基本消化，从我们观察到的情况看，药企正常的学术会议逐渐开展，院内诊疗服务有序恢复。从长周期视角，每次政策扰动在短期都会影响市场情绪，但经过一段时间的消化，很多上市公司的竞争力、业绩、股价都会再上一个台阶，优秀的公司更容易脱颖而出。因此我们持续维持了医药的高比例配置，并在结构上偏向于临床价值更明确、刚性更强的领域。

消费依然分化明显，一方面超高端消费仍然具备相当的韧性，一方面性价比消费成为热点。因此我们保留了超高端白酒及增加了纺服领域的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，浙商大数据智选消费混合 A 基金份额净值为 1.708 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.28%；截至本报告期末浙商大数据智选消费混合 C 基金份额净值为 1.685 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.01%；同期业绩比较基准收益率为-10.39%。

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 24 年，我们认为经济增长的范式变化让以前的很多投资逻辑不再有效，消费粘性是在居民收入持续增长和消费升级的大前提下产生的，这些行业是典型的高毛利行业，一旦需求下降，行业发生恶性竞争的可能性很大。如果消费者把追求极致性价比当成终极社会正义和第一性需求，各行业洗牌的可能性很大，以前的消费投资逻辑暂时无效，股价失去估值锚，因此消费行业大概率低估值和高股息才是支撑股价的关键因素。

除了消费股本身的业绩之外，更大的变化是投资者的预期，过去消费股的投资逻辑大多基于消费升级，在这个基数上变化出提价、扩品类、品牌势能等投资逻辑，所有消费股虽然也是制造业，但通常能获得比制造业的消费品代工企业更高的估值。可一旦消费升级这个逻辑动摇了，很多逻辑的根基就不存在了，就算企业的业绩一样维持，投资者也不知道未来是否可以持续，那至少在市场不好的时候估值下限会不断被打破，所以股息率非常重要，它的标准比 PE 稳定的多。而消费板块很多公司要么是国资委控股，相对更接受分红，要么是产能最早出清的传统行业，即使是民营企业也有大股东持股比例高，更有意愿分红，未来我们会在这类资产中更多的挖掘投资机会，为持有人获得更好的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人监察稽核工作重点是加强基金投资交易的风险控制，保证本基金投资运作的合法合规性。通过加大日常业务检查力度，对公司投研、营销、运作等业务进行专项检查，开展员工行为合规检查，进行投资研究、销售等业务的合规培训，来增强员工合规意识，促进公司业务的合规运作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，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，会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作的估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。公司估值委员会成员中不包括基金经理。报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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	毕马威华振审字第 2401980 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	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>该基金管理人浙商基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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，该基金管理人管理层负责评估该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</p>

	<p>用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</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。</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>(1) 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。</p> <p>(2) 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>(3) 评价该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>(4) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>张楠 朱鹏飞</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 2 幢 25 楼</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2024 年 03 月 29 日</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	76,830,548.35	28,939,455.10
结算备付金		317,690.91	1,549,963.90
存出保证金		145,755.47	158,411.57
交易性金融资产	7.4.7.2	211,907,160.70	400,520,447.61
其中：股票投资		211,907,160.70	400,520,447.61
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		149,262.52	70,380.31
应收股利		-	-
应收申购款		66,843.95	59,606.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		289,417,261.90	431,298,265.46
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		113,635.42	643,962.65

应付管理人报酬		296,920.09	539,106.47
应付托管费		49,486.69	89,851.10
应付销售服务费		224.42	351.43
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	418,670.85	1,061,824.64
负债合计		878,937.47	2,335,096.29
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	168,959,400.00	220,265,136.99
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	119,578,924.43	208,698,032.18
净资产合计		288,538,324.43	428,963,169.17
负债和净资产总计		289,417,261.90	431,298,265.46

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，浙商大数据智选消费 A 份额净值 1.7080 元，基金份额总额 168,765,378.07 份，浙商大数据智选消费 C 份额净值 1.6850 元，基金份额总额 194,021.93 份，总份额合计 168,959,400.00 份。

7.2 利润表

会计主体：浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-35,796,378.31	-130,435,953.09
1. 利息收入		255,542.78	203,549.01
其中：存款利息收入	7.4.7.13	224,200.32	203,549.01
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		31,342.46	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,400,037.50	-98,232,021.10
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-21,990,345.19	-103,432,505.07
基金投资收益	7.4.7.15	-	-
债券投资收益	7.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.17	-	-
收益		-	-

贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	3,590,307.69	5,200,483.97
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-17,721,906.71	-32,645,360.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	70,023.12	237,879.89
减：二、营业总支出		6,093,822.44	8,559,402.63
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,056,764.61	7,171,393.05
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	842,794.07	1,195,232.16
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,545.02	1,834.80
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.25	191,718.74	190,942.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-41,890,200.75	-138,995,355.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-41,890,200.75	-138,995,355.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-41,890,200.75	-138,995,355.72

7.3 净资产变动表

会计主体：浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	220,265,136.99	-	208,698,032.18	428,963,169.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	220,265,136.99	-	208,698,032.18	428,963,169.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-51,305,736.99	-	-89,119,107.75	-140,424,844.74
(一)、综合收益总额	-	-	-41,890,200.75	-41,890,200.75
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-51,305,736.99	-	-47,228,907.00	-98,534,643.99
其中：1. 基金申购款	16,851,115.60	-	15,491,959.78	32,343,075.38
2. 基金赎回款	-68,156,852.59	-	-62,720,866.78	-130,877,719.37
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	168,959,400.00	-	119,578,924.43	288,538,324.43
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	237,149,367.26	-	365,949,002.65	603,098,369.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	237,149,367.26	-	365,949,002.65	603,098,369.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,884,230.27	-	-157,250,970.47	-174,135,200.74
(一)、综合收益总额	-	-	-138,995,355.72	-138,995,355.72
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-16,884,230.27	-	-18,255,614.75	-35,139,845.02
其中：1. 基金申购款	49,448,332.36	-	58,779,723.81	108,228,056.17
2. 基金赎回款	-66,332,562.63	-	-77,035,338.56	-143,367,901.19
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	220,265,136.99	-	208,698,032.18	428,963,169.17

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：

王波

基金管理人负责人

王波

主管会计工作负责人

王波

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资

资基金注册的批复》(证监许可[2016]1283号)批准,由浙商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2017年1月11日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为488,689,300.96份基金份额。本基金的基金管理人为浙商基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、权证、股指期货等权益类金融工具,以及债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0-95%,投资于消费主题的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证主要消费行业指数 \times 60%+上证国债指数收益率 \times 40%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况、2023年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产

在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该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。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，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。

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以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。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产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。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的

现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计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

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益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确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期

损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；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 6 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；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相应类别的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；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类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；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值

日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、

地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b)对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d)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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	76,830,548.35	28,939,455.10
等于：本金	76,822,938.87	28,936,395.35
加：应计利息	7,609.48	3,059.75
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-

等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	76,830,548.35	28,939,455.10

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	209,880,468.95	-	211,907,160.70	2,026,691.75
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	209,880,468.95	-	211,907,160.70	2,026,691.75
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	380,771,849.15	-	400,520,447.61	19,748,598.46
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	380,771,849.15	-	400,520,447.61	19,748,598.46

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何黄金衍生品。

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

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金于本报告期及上年度末均无债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均无其他债权投资减值准备。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金于本报告期及上年度末均未持有其他权益工具。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金于本报告期及上年度末均未持有其他权益工具。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金于本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	100.60	1,151.20

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	248,570.25	890,673.44
其中：交易所市场	248,570.25	890,673.44
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	418,670.85	1,061,824.64

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

浙商大数据智选消费 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	220,010,919.87	220,010,919.87
本期申购	16,562,716.40	16,562,716.40
本期赎回（以“-”号填列）	-67,808,258.20	-67,808,258.20
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	168,765,378.07	168,765,378.07

浙商大数据智选消费 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	254,217.12	254,217.12
本期申购	288,399.20	288,399.20
本期赎回（以“-”号填列）	-348,594.39	-348,594.39
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	194,021.93	194,021.93

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

浙商大数据智选消费 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	146,115,079.22	62,344,736.01	208,459,815.23
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	146,115,079.22	62,344,736.01	208,459,815.23
本期利润	-24,138,288.04	-17,721,450.21	-41,859,738.25
本期基金份额交易产生的变动数	-34,717,601.36	-12,436,434.66	-47,154,036.02
其中：基金申购款	11,334,283.44	3,903,474.35	15,237,757.79
基金赎回款	-46,051,884.80	-16,339,909.01	-62,391,793.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,259,189.82	32,186,851.14	119,446,040.96

浙商大数据智选消费 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	166,355.22	71,861.73	238,216.95
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	166,355.22	71,861.73	238,216.95
本期利润	-30,006.00	-456.50	-30,462.50
本期基金份额交易产生的变动数	-40,489.22	-34,381.76	-74,870.98
其中：基金申购款	193,310.20	60,891.79	254,201.99
基金赎回款	-233,799.42	-95,273.55	-329,072.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	95,860.00	37,023.47	132,883.47

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	211,285.70	187,355.06
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	10,444.31	14,013.84
其他	2,470.31	2,180.11
合计	224,200.32	203,549.01

注：其他列示的是结算保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-21,990,345.19	-103,432,505.07
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-21,990,345.19	-103,432,505.07

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,030,124,589.07	1,194,627,877.40
减：卖出股票成本总额	1,049,364,417.51	1,294,429,516.72
减：交易费用	2,750,516.75	3,630,865.75
买卖股票差价收入	-21,990,345.19	-103,432,505.07

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.15 基金投资收益

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-买卖债券差价收入。

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,590,307.69	5,200,483.97
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	3,590,307.69	5,200,483.97

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-17,721,906.71	-32,645,360.89
股票投资	-17,721,906.71	-32,645,360.89
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	-17,721,906.71	-32,645,360.89

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	70,005.61	236,677.26
基金转换费收入	17.51	1,202.63
合计	70,023.12	237,879.89

7.4.7.23 持有基金产生的费用

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无持有基金产生的费用。

7.4.7.24 信用减值损失

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	3,718.74	2,942.62
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	191,718.74	190,942.62

7.4.7.26 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
浙商基金管理有限公司（“浙商基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
浙商证券股份有限公司（“浙商证券”）	基金管理人的股东
民生人寿保险股份有限公司（“民生人寿”）	基金管理人的股东
养生堂有限公司	基金管理人的股东
上海聚潮资产管理有限公司（“聚潮资管”）	基金管理人的子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,056,764.61	7,171,393.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,264,609.06	2,842,245.19
应支付基金管理人的净管理费	2,792,155.55	4,329,147.86

注：根据本基金管理人于2023年7月29日发布的《浙商基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月1日起，本基金的管理费率由1.50%年费率下降至1.20%年费率。

支付基金管理人浙商基金管理有限公司的基金管理费自2023年1月1日至2023年7月31日按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付；2023年8月1日至2023年12月31日按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

自2023年1月1日至2023年7月31日，基金管理费计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

自 2023 年 8 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日，基金管理费计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	842,794.07	1,195,232.16

注：根据本基金管理人于 2023 年 7 月 29 日发布的《浙商基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 1 日起，本基金的托管费率由 0.25%年费率下降至 0.20%年费率。

支付基金托管人建设银行的基金托管费自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 31 日按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付；2023 年 8 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 31 日，基金托管费计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数

自 2023 年 8 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日，基金托管费计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20% / 当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 × 0.80%/ 当年天数

2、本基金本报告期及上年度可比期间均未产生关联方销售服务费。

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未持有过本基金。

7.4.10.5.2 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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
建设银行	76,830,548.35	211,285.70	28,939,455.10	187,355.06

注：本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2023年12月31日的相关余额为人民币317,690.91元。（2022年12月31日：人民币1,549,963.90元）

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2023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	受限期	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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定	53.63	75.36	61	3,271.43	4,596.96	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股锁定	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定	41.00	44.16	86	3,526.00	3,797.76	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股锁定	31.68	31.27	191	6,050.88	5,972.57	-
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股锁定	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股锁定	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定	28.88	34.59	318	9,183.84	10,999.62	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定	38.13	28.36	493	18,798.09	13,981.48	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股锁定	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月	新股锁定	51.05	38.52	310	15,825.50	11,941.20	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股锁定	55.68	37.58	215	11,971.20	8,079.70	-
301393	昊帆生	2023年	6个月	新股锁	67.68	59.37	175	11,844.00	10,389.75	-

	物	7月5日		定							
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	18.69	511	13,633.48	9,550.59		-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定	51.88	50.20	180	9,338.40	9,036.00		-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新股锁定	47.58	30.22	327	15,558.66	9,881.94		-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股锁定	39.99	38.81	295	11,797.05	11,448.95		-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股锁定	23.97	20.89	389	9,324.33	8,126.21		-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股锁定	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14		-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股锁定	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96		-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股锁定	28.00	22.67	463	12,964.00	10,496.21		-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股锁定	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10		-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04		-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股锁定	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85		-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股锁定	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82		-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股锁定	67.88	52.74	138	9,367.44	7,278.12		-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股锁定	99.57	81.46	99	9,857.43	8,064.54		-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股锁定	2.66	4.45	5,031	13,382.46	22,387.95		-
301529	福赛科	2023年	6个月	新股锁	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16		-

	技	8月31日		定							
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股锁定	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00		-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股锁定	66.80	58.99	108	7,214.40	6,370.92		-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股锁定	37.56	43.57	232	8,713.92	10,108.24		-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股锁定	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56		-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股锁定	7.33	13.40	1,293	9,477.69	17,326.20		-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定	24.22	18.24	395	9,566.90	7,204.80		-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64		-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股锁定	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76		-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股锁定	11.25	11.07	512	5,760.00	5,667.84		-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定	1.70	4.06	2,456	4,175.20	9,971.36		-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定	16.80	31.19	156	2,620.80	4,865.64		-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股锁定	58.08	57.81	63	3,659.04	3,642.03		-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定	23.10	23.31	142	3,280.20	3,310.02		-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股锁定	15.32	23.87	205	3,140.60	4,893.35		-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股锁定	17.38	16.66	244	4,240.72	4,065.04		-

603231	索宝蛋白	2023年 12月6日	6个月	新股锁定	21.29	21.53	130	2,767.70	2,798.90	-
603275	众辰科技	2023年 8月16日	6个月	新股锁定	49.97	39.70	102	5,096.94	4,049.40	-
603276	恒兴新材	2023年 9月18日	6个月	新股锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023年 12月13日	6个月	新股锁定	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688548	广钢气体	2023年 8月8日	6个月	新股锁定	9.87	12.75	1,372	13,541.64	17,493.00	-
688549	中巨芯	2023年 8月30日	6个月	新股锁定	5.18	8.09	1,975	10,230.50	15,977.75	-
688563	航材股份	2023年 7月12日	6个月	新股锁定	78.99	60.49	255	20,142.45	15,424.95	-
688582	芯动联科	2023年 6月21日	6个月	新股锁定	26.74	38.67	399	10,669.26	15,429.33	-
688591	泰凌微	2023年 8月18日	6个月	新股锁定	24.98	28.02	469	11,715.62	13,141.38	-
688602	康鹏科技	2023年 7月13日	6个月	新股锁定	8.66	11.06	864	7,482.24	9,555.84	-
688612	威迈斯	2023年 7月19日	6个月	新股锁定	47.29	37.97	194	9,174.26	7,366.18	-
688627	精智达	2023年 7月11日	6个月	新股锁定	46.77	87.72	206	9,634.62	18,070.32	-
688651	盛邦安全	2023年 7月19日	6个月	新股锁定	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年 11月22日	6个月	新股锁定	31.95	52.25	247	7,891.65	12,905.75	-
688653	康希通信	2023年 11月10日	6个月	新股锁定	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-

688657	浩辰软件	2023年 9月25日	6个月	新股锁定	103.40	78.23	83	8,582.20	6,493.09	-
688693	锆威特	2023年 8月10日	6个月	新股锁定	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年 9月6日	6个月	新股锁定	42.66	48.18	237	10,110.42	11,418.66	-
688716	中研股份	2023年 9月13日	6个月	新股锁定	29.66	36.39	249	7,385.34	9,061.11	-
688720	艾森股份	2023年 11月29日	6个月	新股锁定	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金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

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险

● 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以合规与风险控制委员会为核心的，由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向合规与风险控制委员会提交独立的监察稽核报告和建议；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

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建设银行，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，本基金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发行的证券，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并采用券款对付交割方式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

注：本基金于本期末及上年度末均未持有短期债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本期末及上年度末未持有短期资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本期末及上年度末未持有短期同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有长期债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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严格按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金 7 日可变现资产始终保持较高水平，基金资产整体具备良好流动性。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

下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负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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							
货币资金	76,830,548.35	-	-	-	-	-	76,830,548.35
结算备付金	317,690.91	-	-	-	-	-	317,690.91
存出保证金	145,755.47	-	-	-	-	-	145,755.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-211,907,160.70	211,907,160.70
应收申购款	-	-	-	-	-	66,843.95	66,843.95
应收清算款	-	-	-	-	-	149,262.52	149,262.52
资产总计	77,293,994.73	-	-	-	-	-212,123,267.17	289,417,261.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	113,635.42	113,635.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	296,920.09	296,920.09
应付托管费	-	-	-	-	-	49,486.69	49,486.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	224.42	224.42

其他负债	-	-	-	-	-	418,670.85	418,670.85
负债总计	-	-	-	-	-	878,937.47	878,937.47
利率敏感度缺口	77,293,994.73	-	-	-	-	-211,244,329.70	288,538,324.43
上年度末 2022 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							
货币资金	28,939,455.10	-	-	-	-	-	28,939,455.10
结算备付金	1,549,963.90	-	-	-	-	-	1,549,963.90
存出保证金	158,411.57	-	-	-	-	-	158,411.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-400,520,447.61	400,520,447.61
应收申购款	-	-	-	-	-	59,606.97	59,606.97
应收清算款	-	-	-	-	-	70,380.31	70,380.31
资产总计	30,647,830.57	-	-	-	-	-400,650,434.89	431,298,265.46
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	643,962.65	643,962.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	539,106.47	539,106.47
应付托管费	-	-	-	-	-	89,851.10	89,851.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	351.43	351.43
其他负债	-	-	-	-	-	1,061,824.64	1,061,824.64
负债总计	-	-	-	-	-	2,335,096.29	2,335,096.29
利率敏感度缺口	30,647,830.57	-	-	-	-	-398,315,338.60	428,963,169.17

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-	-
市场利率下降 25 个基点	-	-	

注：于本年末及上年末，本基金均未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

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，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，在科学分析与有效管理信用风险的基础上，实现风险与收益的最佳匹配。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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发行的证券，不得超过该证券的 10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2023年12月31日		上年度末 2022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	211,907,160.70	73.44	400,520,447.61	93.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	211,907,160.70	73.44	400,520,447.61	93.37

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除敏感性分析基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	8,170,191.64	18,913,854.47
沪深 300 指数下降 5%	-8,170,191.64	-18,913,854.47	

注：本基金以沪深 300 指数作为其他价格波动风险的敏感性分析基准。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	211,292,730.22	399,557,347.67
第二层次	-	-
第三层次	614,430.48	963,099.94
合计	211,907,160.70	400,520,447.61

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	963,099.94	963,099.94
当期购买	-	538,232.71	538,232.71
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	963,099.94	963,099.94
当期利得或损失总额	-	76,197.77	76,197.77
其中：计入损益的利得或损失	-	76,197.77	76,197.77
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	614,430.48	614,430.48
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	76,197.77	76,197.77
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,535,662.65	1,535,662.65
当期购买	-	887,816.80	887,816.80
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,535,662.65	1,535,662.65

当期利得或损失总额	-	75,283.14	75,283.14
其中：计入损益的利得或损失	-	75,283.14	75,283.14
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	963,099.94	963,099.94
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	75,283.14	75,283.14

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	614,430.48	亚式期权模型	预期波动率	14.62%-217.75%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	963,099.94	亚式期权模型	预期波动率	18.91%-247.56%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：无)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	211,907,160.70	73.22
	其中：股票	211,907,160.70	73.22
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	77,148,239.26	26.66
8	其他各项资产	361,861.94	0.13
9	合计	289,417,261.90	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

金额单位：人民币元

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	419,212.40	0.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	173,378,493.52	60.09
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	22,737,012.68	7.88
G	交通运输、仓储和邮政业	5,667.84	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,179.89	0.03
J	金融业	1,990.89	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	36,981.40	0.01
M	科学研究和技术服务业	9,800,445.26	3.40
N	水利、环境和公共设施管理业	8,932.82	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	5,445,244.00	1.89
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	211,907,160.70	73.44

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	600519	贵州茅台	12,630	21,799,380.00	7.56
2	600079	人福医药	535,300	13,307,558.00	4.61
3	002262	恩华药业	461,000	12,502,320.00	4.33
4	600276	恒瑞医药	238,500	10,787,355.00	3.74
5	603259	药明康德	134,500	9,786,220.00	3.39
6	600557	康缘药业	444,808	9,127,460.16	3.16
7	688266	泽璟制药	164,373	8,701,906.62	3.02
8	000999	华润三九	157,914	7,853,063.22	2.72
9	000963	华东医药	174,700	7,243,062.00	2.51
10	600976	健民集团	99,900	6,518,475.00	2.26
11	000423	东阿阿胶	130,800	6,451,056.00	2.24
12	300406	九强生物	332,400	6,348,840.00	2.20
13	000403	派林生物	232,200	6,325,128.00	2.19
14	300705	九典制药	182,600	6,067,798.00	2.10
15	688575	亚辉龙	262,038	5,992,809.06	2.08
16	603368	柳药集团	316,344	5,985,228.48	2.07
17	600535	天士力	344,200	5,858,284.00	2.03
18	300015	爱尔眼科	344,200	5,445,244.00	1.89
19	300723	一品红	167,900	5,008,457.00	1.74
20	600809	山西汾酒	20,474	4,723,966.02	1.64
21	600422	昆药集团	222,900	4,649,694.00	1.61
22	600129	太极集团	94,878	4,408,031.88	1.53
23	300558	贝达药业	80,800	4,165,240.00	1.44
24	603198	迎驾贡酒	50,600	3,354,274.00	1.16
25	688428	诺诚健华	282,501	3,248,761.50	1.13
26	601607	上海医药	177,700	2,972,921.00	1.03
27	600161	天坛生物	95,900	2,967,146.00	1.03
28	002603	以岭药业	126,300	2,913,741.00	1.01
29	688687	凯因科技	81,972	2,857,543.92	0.99

30	002755	奥赛康	258,500	2,796,970.00	0.97
31	300294	博雅生物	82,300	2,771,864.00	0.96
32	002653	海思科	84,200	1,949,230.00	0.68
33	002693	双成药业	200,000	1,502,000.00	0.52
34	000513	丽珠集团	42,300	1,480,923.00	0.51
35	603998	方盛制药	67,600	740,896.00	0.26
36	603439	贵州三力	38,600	728,768.00	0.25
37	002714	牧原股份	10,180	419,212.40	0.15
38	600887	伊利股份	15,000	401,250.00	0.14
39	002294	信立泰	10,800	352,728.00	0.12
40	002508	老板电器	12,300	267,894.00	0.09
41	002675	东诚药业	8,000	146,640.00	0.05
42	301529	福赛科技	1,816	72,009.06	0.02
43	001326	联域股份	986	53,715.67	0.02
44	603373	安邦护卫	876	36,981.40	0.01
45	603075	热威股份	1,411	34,108.65	0.01
46	688236	春立医疗	925	24,327.50	0.01
47	301526	国际复材	5,031	22,387.95	0.01
48	300904	威力传动	304	18,705.12	0.01
49	688627	精智达	206	18,070.32	0.01
50	688548	广钢气体	1,372	17,493.00	0.01
51	301558	三态股份	1,293	17,326.20	0.01
52	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.01
53	688549	中巨芯	1,975	15,977.75	0.01
54	301262	海看股份	508	15,824.20	0.01
55	688582	芯动联科	399	15,429.33	0.01
56	688563	航材股份	255	15,424.95	0.01
57	688543	国科军工	267	14,925.30	0.01
58	301382	蜂助手	408	14,532.96	0.01
59	603605	珀莱雅	143	14,214.20	0.00
60	301291	明阳电气	493	13,981.48	0.00
61	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
62	688591	泰凌微	469	13,141.38	0.00
63	688652	京仪装备	247	12,905.75	0.00
64	600587	新华医疗	500	12,895.00	0.00
65	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
66	301362	民爆光电	310	11,941.20	0.00
67	301498	乖宝宠物	295	11,448.95	0.00
68	688702	盛科通信	237	11,418.66	0.00
69	301251	威尔高	318	10,999.62	0.00
70	301511	德福科技	463	10,496.21	0.00
71	301393	昊帆生物	175	10,389.75	0.00
72	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00

73	603130	云中马	480	10,344.00	0.00
74	301332	德尔玛	835	10,203.70	0.00
75	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
76	301550	斯菱股份	232	10,108.24	0.00
77	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
78	601096	宏盛华源	2,456	9,971.36	0.00
79	301468	博盈特焊	327	9,881.94	0.00
80	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
81	600600	青岛啤酒	128	9,568.00	0.00
82	688602	康鹏科技	864	9,555.84	0.00
83	301395	仁信新材	511	9,550.59	0.00
84	001333	光华股份	426	9,431.64	0.00
85	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
86	301290	东星医疗	330	9,104.70	0.00
87	688716	中研股份	249	9,061.11	0.00
88	301418	协昌科技	180	9,036.00	0.00
89	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
90	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
91	301323	新莱福	228	8,433.72	0.00
92	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
93	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
94	301500	飞南资源	389	8,126.21	0.00
95	301371	敷尔佳	215	8,079.70	0.00
96	301525	儒竞科技	99	8,064.54	0.00
97	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
98	000858	五粮液	57	7,997.67	0.00
99	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
100	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
101	688612	威迈斯	194	7,366.18	0.00
102	301520	万邦医药	138	7,278.12	0.00
103	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
104	301559	中集环科	395	7,204.80	0.00
105	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
106	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
107	688657	浩辰软件	83	6,493.09	0.00
108	301548	崇德科技	108	6,370.92	0.00
109	301026	浩通科技	203	6,181.35	0.00
110	001378	德冠新材	191	5,972.57	0.00
111	601083	锦江航运	512	5,667.84	0.00
112	603119	浙江荣泰	205	4,893.35	0.00
113	603004	鼎龙科技	156	4,865.64	0.00
114	001306	夏厦精密	61	4,596.96	0.00
115	301036	双乐股份	205	4,544.85	0.00

116	603193	润本股份	244	4,065.04	0.00
117	603275	众辰科技	102	4,049.40	0.00
118	603816	顾家家居	113	3,955.00	0.00
119	001358	兴欣新材	86	3,797.76	0.00
120	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
121	603062	麦加芯彩	63	3,642.03	0.00
122	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
123	603231	索宝蛋白	130	2,798.90	0.00
124	001367	海森药业	55	2,417.80	0.00
125	002142	宁波银行	99	1,990.89	0.00
126	603866	桃李面包	214	1,639.24	0.00
127	002507	涪陵榨菜	100	1,429.00	0.00
128	600690	海尔智家	33	693.00	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	000858	五粮液	31,268,943.06	7.29
2	000568	泸州老窖	30,877,515.01	7.20
3	603259	药明康德	23,198,117.40	5.41
4	688266	泽璟制药	22,516,252.84	5.25
5	000999	华润三九	17,598,867.02	4.10
6	000596	古井贡酒	17,596,674.00	4.10
7	300406	九强生物	17,208,207.65	4.01
8	600809	山西汾酒	16,978,180.83	3.96
9	600129	太极集团	16,061,391.05	3.74
10	600276	恒瑞医药	15,609,301.00	3.64
11	601607	上海医药	14,617,996.45	3.41
12	002714	牧原股份	14,398,186.85	3.36
13	600600	青岛啤酒	14,359,736.00	3.35
14	002603	以岭药业	14,279,952.51	3.33
15	002262	恩华药业	13,643,185.00	3.18
16	600587	新华医疗	13,380,996.00	3.12
17	600511	国药股份	13,128,004.00	3.06
18	688338	赛科希德	12,678,939.53	2.96
19	600690	海尔智家	11,631,088.13	2.71
20	600519	贵州茅台	11,499,185.00	2.68
21	603368	柳药集团	11,407,671.80	2.66
22	002020	京新药业	11,404,547.00	2.66
23	300705	九典制药	11,382,771.00	2.65

24	600559	老白干酒	11,027,295.00	2.57
25	002294	信立泰	10,969,710.25	2.56
26	600351	亚宝药业	10,460,096.00	2.44
27	000963	华东医药	10,378,899.00	2.42
28	002675	东诚药业	10,082,057.00	2.35
29	600422	昆药集团	9,995,022.00	2.33
30	002821	凯莱英	9,967,841.00	2.32
31	002415	海康威视	9,420,979.64	2.20
32	600436	片仔癀	9,376,561.00	2.19
33	688373	盟科药业	9,345,760.06	2.18
34	002508	老板电器	8,877,656.00	2.07
35	603816	顾家家居	8,868,173.60	2.07
36	605266	健之佳	8,744,655.12	2.04
37	688575	亚辉龙	8,665,590.90	2.02

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	000568	泸州老窖	38,222,541.40	8.91
2	000858	五粮液	37,577,823.00	8.76
3	600600	青岛啤酒	35,287,200.60	8.23
4	600690	海尔智家	30,036,887.00	7.00
5	600436	片仔癀	24,424,725.62	5.69
6	300760	迈瑞医疗	22,390,264.50	5.22
7	600587	新华医疗	21,808,061.00	5.08
8	600519	贵州茅台	21,098,940.00	4.92
9	300896	爱美客	20,266,387.74	4.72
10	600129	太极集团	20,138,940.92	4.69
11	300633	开立医疗	19,407,360.00	4.52
12	000915	华特达因	18,941,243.80	4.42
13	002508	老板电器	17,352,116.11	4.05
14	000963	华东医药	17,154,209.20	4.00
15	000596	古井贡酒	15,688,614.00	3.66
16	603456	九洲药业	15,582,802.48	3.63
17	600809	山西汾酒	15,304,203.00	3.57
18	600132	重庆啤酒	15,070,648.00	3.51
19	688266	泽璟制药	14,782,626.22	3.45
20	300705	九典制药	14,517,309.62	3.38
21	002294	信立泰	13,898,226.78	3.24
22	002714	牧原股份	13,743,558.34	3.20
23	603259	药明康德	13,637,889.60	3.18
24	600276	恒瑞医药	12,655,554.00	2.95

25	688338	赛科希德	12,387,860.43	2.89
26	300347	泰格医药	12,257,433.72	2.86
27	300723	一品红	11,954,895.94	2.79
28	002461	珠江啤酒	11,194,337.00	2.61
29	600351	亚宝药业	11,032,265.00	2.57
30	002653	海思科	10,875,859.20	2.54
31	688337	普源精电	10,856,248.33	2.53
32	300406	九强生物	10,376,790.00	2.42
33	002020	京新药业	10,285,914.00	2.40
34	601607	上海医药	9,715,372.00	2.26
35	600511	国药股份	9,686,807.00	2.26
36	600559	老白干酒	9,635,287.00	2.25
37	688363	华熙生物	9,555,993.95	2.23
38	688373	盟科药业	9,326,304.61	2.17
39	000999	华润三九	9,325,576.54	2.17
40	002675	东诚药业	9,292,617.00	2.17
41	002821	凯莱英	9,219,738.00	2.15
42	002262	恩华药业	9,133,574.00	2.13
43	002603	以岭药业	9,004,508.80	2.10
44	688301	奕瑞科技	8,970,926.24	2.09

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	878,473,037.31
卖出股票收入（成交）总额	1,030,124,589.07

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金本报告期末投资基金。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

8.13.3 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	145,755.47
2	应收清算款	149,262.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	66,843.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	361,861.94

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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

份额级别	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 (%)
浙商大数 据智选消 费 A	33,852	4,985.39	40,736.96	0.02	168,724,641.11	99.98
浙商大数 据智选消 费 C	126	1,539.86	18,527.11	9.55	175,494.82	90.45
合计	33,978	4,972.61	59,264.07	0.04	168,900,135.93	99.96

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	浙商大数据智选消费 A	281,065.36	0.1665
	浙商大数据智选消费 C	6,799.51	3.5045
	合计	287,864.87	0.1704

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	份额级别	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	浙商大数据智选消费 A	10~50
	浙商大数据智选消费 C	0
	合计	10~50

本基金基金经理持有本 开放式基金	浙商大数据智选消费 A	0
	浙商大数据智选消费 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况

注：本基金无期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的
产品情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C
基金合同生效日 (2017 年 1 月 11 日) 基金份额总额	488,689,300.96	-
本报告期期初基金份 额总额	220,010,919.87	254,217.12
本报告期基金总申购 份额	16,562,716.40	288,399.20
减：本报告期基金总 赎回份额	67,808,258.20	348,594.39
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	168,765,378.07	194,021.93

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

报告期内，基金管理人的重大人事变动：

2023 年 1 月 17 日，郭乐琦女士离任浙商基金管理有限公司督察长职务，总经理王波代行
督察长一职；

2023 年 7 月 10 日，纪士鹏先生担任浙商基金管理有限公司督察长职务；
 2023 年 12 月 12 日，唐生林先生离任浙商基金管理有限公司首席信息官职务；
 2023 年 12 月 21 日，鞠海洋先生担任浙商基金管理有限公司首席信息官职务。
 本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所，本报告年度的审计费用为 50,000.00 元。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 9 月 20 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会浙江证监局
受到的具体措施类型	责令改正措施
受到稽查或处罚等措施的原因	公司部分业务内部控制不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已及时按要求改正并报告
其他	-

11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉

违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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 (%)	
川财证券	2	334,188,955.24	17.61	312,227.67	18.10	-
东方财富证券	2	279,622,490.00	14.74	261,742.85	15.17	-
野村东方国际证券	1	277,840,515.47	14.64	258,889.20	15.01	-
摩根大通	1	213,540,383.65	11.25	200,410.18	11.62	-
财通证券	2	170,328,511.23	8.98	158,624.98	9.20	-
信达证券	1	154,076,352.48	8.12	143,909.93	8.34	-
华宝证券	1	134,241,543.82	7.07	125,807.63	7.29	-
华创证券	1	119,774,090.17	6.31	53,408.40	3.10	-
兴业证券	1	112,076,917.45	5.91	112,079.69	6.50	-
广发证券	1	45,648,362.36	2.41	42,512.94	2.46	-
长城证券	1	45,281,023.35	2.39	45,282.03	2.63	-
东方证券	2	10,860,084.31	0.57	10,114.04	0.59	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 遵循国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定的要求；
- (2) 维护持有人利益，不利用基金资产进行利益输送，不承诺交易量；
- (3) 以券商服务质量作为席位选择和佣金分配的标准。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 股票投资部、市场销售总部

a、专员与券商联系商讨合作意向，根据公司及基金法律文件中对券商席位的选择标准，并参考中央交易室主管的建议，确定新基金租用或基金新租用席位的所属券商以及（主）席位。

b、报公司分管领导审核通过。

(2) 中央交易室

a、专员将我公司格式版本的《证券交易席位使用协议》发送给券商相关业务联系人。

b、券商对我公司提供的协议有修改意见的，其内容若涉及股票投资部、市场销售总部、基金运营部的，由专员分别将此内容发送给上述部门审议，并由专员将我公司各职能部门反馈的意见与券商进行商议，形成一致意见后完成协议初稿，交我公司监察稽核部审核。

c、对券商和我公司双方同意的协议文本进行签字盖章。我公司盖章程序，由专员填写合同流转单，分别送达股票投资部、市场销售总部、基金运营部、监察稽核部签字，最后盖章。

3、本基金报告期内券商交易单元变更情况：

(1) 新增或退租券商交易单元：新增华创证券（45590）；新增西南证券（58519）。

(2) 上表中所列交易单元均与浙商日添利货币市场基金和浙商丰利增强债券型证券投资基金共用。

11.8.2 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	
	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(%)
川财证券	-	-	20,000,000.00	100.00	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
摩根大	-	-	-	-	-	-

通						
财通证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

11.9 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	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2023 年 1 月 18 日
2	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023 年 3 月 30 日
3	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2023 年 4 月 20 日
4	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定媒介	2023 年 7 月 6 日

5	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定媒介	2023 年 7 月 6 日
6	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2023 年 7 月 20 日
7	浙商大数据智选消费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	2023 年 7 月 29 日
8	浙商大数据智选消费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	2023 年 7 月 29 日
9	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定媒介	2023 年 8 月 2 日
10	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2023 年 8 月 2 日
11	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会指定媒介	2023 年 8 月 31 日
12	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2023 年 10 月 24 日
13	关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2023 年 11 月 22 日

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
产品特有风险							
<p>(1) 赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>(3) 提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于 5,000 万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算。</p> <p>(4) 基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

注：本报告期内无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

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金设立的相关文件；
- 2、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 3、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.zsfund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-067-9908/021-60359000 查询相关信息。

浙商基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日