

---

# 浙商汇金先进制造混合型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人:浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月25日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

浙江浙商证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年07月01日起至2024年09月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 浙商汇金先进制造混合  |
| 基金主代码      | 013145  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2021年08月16日   |
| 报告期末基金份额总额 | 50,765,636.62份  |
| 投资目标       | 本基金通过积极调整仓位、精选先进制造主题的优质上市公司进行投资，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略       | (一) 资产配置策略；<br>(二) 股票投资策略；<br>(三) 债券等固定收益类资产投资策略；<br>(四) 金融衍生工具投资策略；<br>(五) 资产支持证券投资策略；<br>(六) 可转换债券和可交换债券投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数收益率×60%+中债总财富指数（总值）收益率×40%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金，一般市场情况下，长期  |

|       |                               |
|-------|-------------------------------|
|       | 风险收益特征高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 |
| 基金管理人 | 浙江浙商证券资产管理有限公司                |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司                  |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期（2024年07月01日 - 2024年09月30日） |
|----------------|--------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 436,704.98                     |
| 2.本期利润         | 5,354,953.55                   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1049                         |
| 4.期末基金资产净值     | 36,789,647.88                  |
| 5.期末基金份额净值     | 0.7247                         |

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 17.08%  | 1.97%     | 10.03%     | 0.93%         | 7.05%   | 1.04% |
| 过去六个月      | 13.45%  | 1.55%     | 9.41%      | 0.73%         | 4.04%   | 0.82% |
| 过去一年       | 2.42%   | 1.46%     | 8.31%      | 0.65%         | -5.89%  | 0.81% |
| 过去三年       | -30.43% | 1.22%     | -4.64%     | 0.65%         | -25.79% | 0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | -31.44% | 1.21%     | -5.36%     | 0.65%         | -26.08% | 0.56% |

注：本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%+中债总财富指数（总值）收益率×40%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务  | 任本基金的基金经理期限 |            | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|---|-------------|------------|--------|---|
|     |   | 任职日期        | 离任日期       |        |   |
| 马斌博 | 浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型基金(LOF)、浙商汇金转型成长混合型基金的基金经理 | 2021-08-16  | 2024-09-02 | 12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、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金联接基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型基金、浙商汇金兴利增强债券型基金、浙商汇金先进制造混合型 |

|    |         |            |   |     |  |
|----|---------|------------|---|-----|--|
|    |         |            |   |     | 基金的基金经理；现任浙商汇金转型成长混合型、浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型(LOF)的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。   |
| 王霆 | 本基金基金经理 | 2024-09-02 | - | 14年 | 中国国籍，硕士，曾任职于国联证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、长城证券股份有限公司、泰信基金管理有限公司、格林基金管理有限公司、国华兴益保险资产管理有限公司，历任行业研究员、基金经理。2024年6月加入浙江浙商证券资产管理有限公司，现任公募权益投资部高级业务副总监，任浙商汇金先进制造混合型基金的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。 |

注：1、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。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.1 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，以确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《浙江浙商证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

5月下旬以来一直到9月中旬，市场持续震荡回调。对于行业和公司基本面的担忧，一直是压制今年市场表现的重要因素之一，对于业绩的担忧持续压制风险偏好的回升。上证综指在9月中旬最低跌至2690点，市场整体较为悲观，A股总成交量在8-9月缩至5000亿元左右。

9月中下旬出现重要了一系列重要信号和转折点：

1) 9月18日，美联储宣布下调基准利率区间50个基点至4.75%—5.00%，同时美联储官员对2024年末美联储利率预期的中位数落在4.25%—4.50%。这是自2020年3月以来的首次降息。

2) 9月24日，国新办召开新闻发布会，央行、金融监管总局、证监会负责人同时出席，发布重要政策，涉及多个重要领域，包括货币政策、财政政策、房地产、消费、资本市场。

3) 9月26日，中共中央政治局召开会议分析研究当前经济形势，部署下一步经济工作。

4) 9月26号，中央金融办、中国证监会联合印发《关于推动中长期资金入市的指导意见》

三季度结构性机会较少，季度前半段我们保持中等偏低的仓位，以研究为主。随着本轮政策组合拳落地，对后续经济修复、流动性宽松、市场情绪改善均有积极影响。在以上重要会议和政策推出后，我们进行了积极的仓位和持仓调整，在货币政策、财政政策等重点支持的领域，包括：先进制造、科技、金融等进行了布局，取得了净值的上涨。

展望2024年四季度及2025年，我们仍然较为乐观，将更多关注财政政策、产业政策的落地进度，以及重点上市公司基本面的变化情况。后续将围绕价值、成长方向寻找合适的投资机会，力争给持有人带来持续的回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商汇金先进制造混合基金份额净值为0.7247元，本报告期内，基金份额净值增长率为17.08%，同期业绩比较基准收益率为10.03%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金于2024年07月01日至2024年09月30日持续出现基金资产净值低于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。基金份额持有人大会于2024年7月11日表决通过了《关于持续运作浙商汇金先进制造混合型证券投资基金的议案》，本次大会决议自该日起生效。会议详情请见2024年7月12日在规定媒介发布的《浙江浙商证券资产管理有限公司关于浙商汇金先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会（二次召开）表决结果暨决议生效的公告》。同时，为保障基金份额持有人利益，自2024年7月1日起，我司承担迷你基金的固定费用，直至产品改变迷你基金状态为止。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 33,819,690.88 | 87.60            |
|    | 其中：股票             | 33,819,690.88 | 87.60            |
| 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      | 3,691,032.53  | 9.56             |
| 8  | 其他资产              | 1,096,223.85  | 2.84             |
| 9  | 合计                | 38,606,947.26 | 100.00           |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 18,572,527.68 | 50.48        |
| 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  | 6,228,569.20  | 16.93        |
| J  | 金融业              | 6,427,130.00  | 17.47        |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,406,169.00  | 3.82         |
| 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          | 1,185,295.00  | 3.22         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 33,819,690.88 | 91.93        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|--------------|--------------|
| 1  | 688111 | 金山办公 | 9,265 | 2,468,196.00 | 6.71         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 2  | 000977 | 浪潮信息 | 56,000 | 2,324,000.00 | 6.32 |
| 3  | 300033 | 同花顺  | 10,500 | 2,029,755.00 | 5.52 |
| 4  | 301236 | 软通动力 | 36,800 | 1,895,936.00 | 5.15 |
| 5  | 603920 | 世运电路 | 69,100 | 1,759,977.00 | 4.78 |
| 6  | 002594 | 比亚迪  | 5,700  | 1,751,667.00 | 4.76 |
| 7  | 603019 | 中科曙光 | 36,694 | 1,751,037.68 | 4.76 |
| 8  | 002050 | 三花智控 | 73,400 | 1,749,122.00 | 4.75 |
| 9  | 002304 | 洋河股份 | 16,900 | 1,676,311.00 | 4.56 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 79,700 | 1,617,910.00 | 4.40 |

#### 5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期收到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 18,184.72    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,033,704.15 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 44,334.98    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 1,096,223.85 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转债。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|             |               |
|-------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 51,195,154.93 |
|-------------|---------------|

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期间基金总申购份额              | 88,018.49     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 517,536.80    |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 50,765,636.62 |

注：总申购份额含红利再投、转入份额，总赎回份额含转出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          |              |
|--------------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 1,373,611.28 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -            |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -            |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 1,373,611.28 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 2.71         |

注：上表列示的报告期间买入/申购总份额含红利再投、转换入份额，列示的报告期间卖出/赎回总份额含转换出份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生固有资金申购、赎回本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会关于准予浙商汇金精选定增集合资产管理计划变更注册的批复；

《浙商汇金先进制造混合型证券投资基金基金合同》；

《浙商汇金先进制造混合型证券投资基金托管协议》；

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。

## 9.2 存放地点

基金管理人住所及托管人住所。

## 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查询；亦可通过公司网站查阅，公司网址为：  
[www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)。

浙江浙商证券资产管理有限公司  
2024年10月25日