

# 浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 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:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 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。本中期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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27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。

本报告中财务资料未经审计。

自2020年5月29日起，《浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《浙商汇金大消费集合资产管理合同》同时失效，浙商汇金大消费集合资产管理计划正式变更为浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30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	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§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	12
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	13
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 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	46
7.7 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	46
7.8 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	46
7.9 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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48

8.3 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 .....	48
§9 开放式基金份额变动 .....	48
§10 重大事件揭示 .....	49
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
11.1 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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
§12 备查文件目录 .....	52
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	浙商汇金新兴消费
基金主代码	009527
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年05月29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	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,051,657.64份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极调整仓位、精选新兴消费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	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金为灵活配置混合型基金，以追求基金资产收益长期增长为目标，在本基金的投资范围内对各类别资产进行灵活的比例配置调整，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，结合各项宏观经济指标和微观经济数据，及时把握货币政策和财政政策，通过对宏观经济指标、盈利预测指标、市场流动性指标等相关因素的综合分析，预估市场未来的趋势变化，评估上市公司业绩和股票价格联动的方式。</p> <p>在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可灵活配置降至0%。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1、新兴消费主题的上市公司范畴界定</p> <p>基于对消费行业发展趋势的分析，本基金主要投资于“新兴消费”主题相关证券，是指受益于人均可支配收入提高、人口结构变化、信息技术发展、传播方</p>

式变革等引发传统消费行业新模式的出现及新需求崛起的公司。

## 2、个股选择

结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度及公司核心竞争力的判断，基金管理人通过传统的定性分析手段，关注具有先进的经营模式、良好的公司治理结构和优秀的公司管理层等核心价值的上市公司；结合管理人定量投资方法，深入挖掘具有持续增长能力或价值被低估的公司，构建股票投资组合，同时将根据行业及公司状况的变化，结合估值水平，动态优化股票投资组合。

### （三）债券等固定收益类资产投资策略

本基金固定收益类资产的投资目标主要为非股票资产的有效使用和管理。在实际管理中，辅助配置短久期、流动性较好的固定收益类资产以及保持现金资产以应对申购赎回资金流、交易成本等因素为本基金固定收益类资产的主要投资策略。

### （四）金融衍生工具投资策略

本基金基于审慎原则运用股指期货、国债期货、股票期权等相关金融衍生工具，将严格根据风险管理的原则，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，从而达到降低投资组合风险、提高投资效率、降低跟踪误差，更好地实现本基金投资目标。

本基金参与股指期货的投资，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的合约，以降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

### （五）资产支持证券投资策略

	<p>对于资产支持证券，本基金将在国内资产证券化品种具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后做出相应的投资决策。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散，以降低流动性风险。</p> <p>(六) 可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>本基金密切跟踪经济运行情况，对各类市场大势做出判断的前提下，对可转换债券及其正股、可交换债券和对应股票进行综合分析；首先自上而下从行业进行评估，再自下而上评估股票的估值、盈利和成长等因素，然后根据债券属性进行综合评定，最终选择投资价值较高的个券。</p>
业绩比较基准	中证主要消费行业指数收益率×70%+中债总财富指数（总值）收益率×30%
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。

### 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	中国光大银行股份有限公司
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	95595
传真	0571-87902581	010-63639132
注册地址	杭州市拱墅区天水巷25号	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼7楼	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	310020	100033

法定代表人	盛建龙	李晓鹏
-------	-----	-----

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.stocke.com.cn
基金中期报告备置地点	杭州市上城区五星路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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期 (2021年01月01日- 2021年06月30日)	
	本期已实现收益	4,884,736.98
本期利润	5,984,109.83	
加权平均基金份额本期利润	0.1761	
本期加权平均净值利润率	11.61%	
本期基金份额净值增长率	11.83%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	期末可供分配利润	8,321,272.66
	期末可供分配基金份额利润	0.2518
	期末基金资产净值	54,283,754.31
	期末基金份额净值	1.6424

<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	57.98%

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未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
过去一个月	2.18%	1.15%	-3.85%	0.86%	6.03%	0.29%
过去三个月	17.42%	1.43%	3.35%	0.99%	14.07%	0.44%
过去六个月	11.83%	1.85%	-1.14%	1.34%	12.97%	0.51%
过去一年	40.05%	1.69%	25.91%	1.26%	14.14%	0.43%
自基金合同生效起至今	57.98%	1.65%	36.08%	1.23%	21.90%	0.42%

注：本基金投资的业绩比较基准为：中证主要消费行业指数收益率×70%+中债总财富指数（总值）收益率×30%

中证主要消费指数是由中证指数有限公司编制开发，它的样本选自中证800指数，由主要消费行业股票组成，以反映该行业公司股票的整体表现，能够全面刻画沪深两市全部消费行业上市公司股票的整体表现。

中债总财富指数（总值）收益率由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖上海证券交易所、深圳证劵交易所以及银行间市场的各类券种，综合反映了债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。该指数合理、透明、公开，具有较好的市场接受度，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

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



注：1、自2020年5月29日起，《浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《浙商汇金大消费集合资产管理合同》同时失效，浙商汇金大消费集合资产管理计划正式变更为浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金。

2、本基金合同于2020年5月29日生效，至本报告期末，本基金已完成建仓，但报告期末距建仓结束不满一年，建仓期为2020年5月29日-2020年11月29日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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2021年06月30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（FOF）、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、浙商汇金安享66个月定期开放债券型证券投资基金和浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金。

#### 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		
周涛	总经理助理；本基金基金经理；浙商汇金转型成长混合型基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型基金及浙商汇金量化精选灵活配置混合型基金的基金经理	2020-06-08	-	15年	中国国籍，硕士，曾任国金证券研究所首席行业分析师、齐鲁证券研究所所长、浙商证券证券投资部总经理、浙商资本副总经理。2017年加入浙江浙商证券资产管理有限公司，现任总经理助理、浙商汇金转型成长混合型基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型基金、浙商汇金新兴消费灵活配置混合型

					基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型基金的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
王凯	本基金基金经理	2020-05-29	-	12年	中国国籍，硕士，历任华安基金行业研究员、从容投资任行业研究员、东北证券资管公司行业研究员。2015年8月加入浙商证券资产管理公司，现任浙商汇金新兴消费灵活配置混合型基金经理。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。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。

2、2021年7月7日，本基金管理人解聘基金经理王凯先生，并已按相关规定备案、公告。

#### 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，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 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金净值上涨11.83%，跑赢同期业绩比较基准及中证消费指数等。

2021年上半年，影响国内资本市场运行的内外宏观因素分别为：美联储缩表的快慢；国内通胀压力的大小。从行业及公司层面看，驱动市场运行的内在动力则是优质赛道的持续高景气以及部分上市公司业绩的持续提升，特别是批量的顺周期行业的持续环比业绩大幅增长。以上因素交织在一起，共同构造了上半年震荡偏强的市场运行格局。在犹犹豫豫中，板块与个股的分化持续加大。1季度出现的抱团股的瓦解，在2季度出现了抱团股的再次分化，一批核心资产在2季度再次创出新高，这些股票主要集中在新能源，部分医药及消费类公司。如果我们从量化的角度分析的话，可以概括为市场交易的核心驱动因子是成长。从分类指数比较看，首先是成长风格的表现，其次才是大小盘风格的表现。

展望下半年，美国经济的复苏相比中国依然有比较优势，全球通胀压力犹存，且本轮经济周期的供给与需求双重驱动特征，表征未来通胀可能整体上台阶。国内出口大概率高位维持、制造业投资稳定增加、消费需求缓慢恢复依然是主旋律。在确定性的流动性收缩背景下，市场依然以结构性特征为主。

以上证综指PE估值测算，当前市场整体估值处于历史60%多分位数，并非全面偏高。且与历史上的类似经济运行阶段并没有很好的可比性。也就是说我们在未来的基金组合管理中，重点是既要挖掘结构性的成长机会，又要兼顾组合的估值高低与防御性，以相对均衡的配置，获取更具性价比的投资回报。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商汇金新兴消费基金份额净值为1.6424元，本报告期内，基金份额净值增长率为11.83%，同期业绩比较基准收益率为-1.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年上半年已经过去，各类投资者对全球经济形势的关注点非常聚焦。其中美联储的Taper成为全球资本市场最为关注的焦点。下半年的重要时间节点为8月底的杰克逊霍尔全球央行会议，以及9月底的FOMC会议，美联储当前及未来将不断提供新的线索，

为正式宣布讨论 Taper 做铺垫，市场预期正式开始实施 Taper 仍可能是今年年底或明年年初。

在此背景之下，由于中国经济与全球经济特别是美国经济的恢复速度并不一致，中国领先于全球复苏，故中国的货币政策提前收缩的预期也更提前。同时我们也看到国内经济的局部韧性表现。综合考虑国际错位与理性应对，预计下半年国内货币政策依然以中性为主，不会过紧也不会过松。

而反观证券市场的表现，经济的持续向好与流动性必然收缩的预期，导致今年的证券市场表现十分特别，1季度的核心资产如“茅”指数的表现，2季度“宁”指数的表现，以及贯穿整个市场的顺周期及中小市值公司的困境反转或者价值重估。反映出市场参与者的焦虑心态，同时也表征出市场参与者的不同风格特性。

预计下半年依然会延续这种结构性的行情特性。每年资本市场运行过程中逃不开的永恒话题是风格转换，今年由于极致的股票表现，大家尤为担忧。我们认为，在各自的能力圈范围内，聚焦相对更加优秀的行业，或者寻找符合自身投资模式的优势个股。以组合的方式去寻求稳健收益可能是其中一个不错的选择。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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2021年02月26日至2021年04月19日持续出现基金净值低于5000万的情形，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，中国光大银行股份有限公司在浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,986,004.77	6,334,120.79
结算备付金		15,056.43	-
存出保证金		4,412.06	5,293.23
交易性金融资产	6.4.7.2	45,532,178.03	46,502,757.35
其中：股票投资		45,532,178.03	46,502,757.35
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	762,661.75
应收利息	6.4.7.5	3,059.56	2,582.98
应收股利		-	-
应收申购款		5,789.07	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		54,546,499.92	53,607,416.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		35,615.77	196,194.43
应付管理人报酬		65,117.09	64,889.99
应付托管费		4,341.17	4,326.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	11,652.01	720.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	146,019.57	142,555.60
负债合计		262,745.61	408,686.65
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	33,051,657.64	36,222,988.71
未分配利润	6.4.7.10	21,232,096.67	16,975,740.74
所有者权益合计		54,283,754.31	53,198,729.45
负债和所有者权益总计		54,546,499.92	53,607,416.10

注：1、报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.6424元，基金份额总额33,051,657.64份。

2、本基金基金合同生效日为2020年5月29日，本报告期的财务报表及报表附注上年度可比区间不完整。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年05月29日（基金 合同生效日）至2020 年06月30日
一、收入		6,490,062.33	5,473,705.39
1. 利息收入		46,100.20	9,817.77

其中：存款利息收入	6.4.7.11	46,100.20	9,817.77
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,341,310.07	1,532,299.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,248,010.19	1,432,513.65
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14. 2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	93,299.88	99,786.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,099,372.85	3,931,587.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	3,279.21	-
<b>减：二、费用</b>		505,952.50	132,073.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	385,886.29	59,489.62
2. 托管费	6.4.10.2. 2	25,725.83	3,965.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	46,167.62	49,579.00
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	48,172.76	19,039.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,984,109.83	5,341,631.46
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,984,109.83	5,341,631.46

注：本基金基金合同生效日为2020年5月29日，本报告期的财务报表及报表附注上年度可比区间不完整。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30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）	36,222,988.71	16,975,740.74	53,198,729.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,984,109.83	5,984,109.83
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）	-3,171,331.07	-1,727,753.90	-4,899,084.97
其中：1. 基金申购款	1,823,320.64	1,021,695.14	2,845,015.78
2. 基金赎回款	-4,994,651.71	-2,749,449.04	-7,744,100.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产	-	-	-

生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	33,051,657.64	21,232,096.67	54,283,754.31
项 目	上年度可比期间		
	2020年05月29日(基金合同生效日)至2020年06月30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)	40,480,451.60	1,603,947.41	42,084,399.01
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	5,341,631.46	5,341,631.46
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)	-405,218.82	-25,261.08	-430,479.90
其中:1.基金申购款	418,385.50	38,898.25	457,283.75
2.基金赎回 款	-823,604.32	-64,159.33	-887,763.65
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)	40,075,232.78	6,920,317.79	46,995,550.57

注:本基金基金合同生效日为2020年5月29日,本报告期的财务报表及报表附注上年度可比区间不完整。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由浙商汇金大消费集合资产管理计划变更注册而来。浙商汇金大消费集合资产管理计划于2011年3月8日经中国证监会证监许可[2011]341号文《关于核准浙商证券有限责任公司设立浙商汇金大消费集合资产管理计划的批复》核准募集，计划的管理人为浙商证券有限责任公司，计划的托管人为中国光大银行股份有限公司。浙商汇金大消费集合资产管理计划自2011年3月23日起至2011年4月22日募集，募集结束后于2011年4月28日成立。《浙商汇金大消费集合资产管理合同》于2011年4月28日生效。根据《基金法》、《运作办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用操作指引》等法律法规的规定及《浙商汇金大消费集合资产管理合同》的约定，并于2020年4月15日经中国证监会证监许可[2020]717号《关于准予浙商汇金大消费集合资产管理计划变更注册的批复》，浙商汇金大消费集合资产管理计划变更注册为浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金。自2020年5月29日起，《浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《浙商汇金大消费集合资产管理合同》同时失效，浙商汇金大消费集合资产管理计划正式变更为浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金，浙江浙商证券资产管理有限公司（以下简称“浙商资产管理公司”）作为管理人，中国光大银行股份有限公司（以下简称“中国光大银行”）作为托管人。本基金类型为混合型证券投资基金，基金的运作方式为契约型、开放式，存续期为不定期。基金合同生效日的基金份额总额为40,245,894.32份基金份额。

### 6.4.2 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《浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定而编制的。

本财务报表以持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金

会计核算业务指引》的要求，真实、完整地反映了本基金2021年06月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年06月30日的经营成果和基金资产净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	8,986,004.77
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	8,986,004.77

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		26,129,706.28	45,532,178.03	19,402,471.75
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		26,129,706.28	45,532,178.03	19,402,471.75

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末，未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末，未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	3,050.76
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	6.80

应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2.00
合计	3,059.56

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末，未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	11,652.01
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,652.01

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	148.74
应付证券出借违约金	-
预提费用	145,870.83
合计	146,019.57

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,222,988.71	36,222,988.71
本期申购	1,823,320.64	1,823,320.64
本期赎回（以“-”号填列）	-4,994,651.71	-4,994,651.71
本期末	33,051,657.64	33,051,657.64

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

#### 6.4.7.10 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	3,981,337.85	12,994,402.89	16,975,740.74
本期利润	4,884,736.98	1,099,372.85	5,984,109.83
本期基金份额交易产生的变动数	-544,802.17	-1,182,951.73	-1,727,753.90
其中：基金申购款	374,575.84	647,119.30	1,021,695.14
基金赎回款	-919,378.01	-1,830,071.03	-2,749,449.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,321,272.66	12,910,824.01	21,232,096.67

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	活期存款利息收入	45,908.87
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	170.72	
其他	20.61	
合计	46,100.20	

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	19,975,549.66
减：卖出股票成本总额	14,727,539.47
买卖股票差价收入	5,248,010.19

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金在本报告期末进行基金投资。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金在本报告期末进行债券投资。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末进行资产支持证券投资。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期末进行贵金属投资。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末进行权证投资。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末进行其他衍生工具投资。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	93,299.88

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	93,299.88

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	1,099,372.85
—— 股票投资	1,099,372.85
—— 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	1,099,372.85

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	3,279.21
合计	3,279.21

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	46,167.62
银行间市场交易费用	-
合计	46,167.62

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
信息披露费	24,795.19
审计费用	21,075.64
中登认购登记结算费	2,301.93
合计	48,172.76

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构

注：本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化，以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年05月29日（基金合同生效日） 至2020年06月30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	17,793,483.57	55.20%	13,273,656.00	37.30%

注：本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

##### 6.4.10.1.2 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。本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

##### 6.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30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	13,012.43	55.77%	647.27	5.56%
关联方名称	上年度可比期间 2020年05月29日（基金合同生效日）至2020年06月30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	9,707.13	35.72%	9,707.13	40.60%

注：1、本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。  
2、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年05月29日（基金合同 生效日）至2020年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	385,886.29	59,489.62
其中：支付销售机构的客户维护费	178,442.66	26,128.69

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费自基金合同生效之日起，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2、本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年05月29日（基金合同生 效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,725.83	3,965.96

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费自基金合同生效之日起，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

2、本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

**6.4.10.4 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****6.4.10.4.1 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**

本基金本报告期内及上年度可比期间，未发生与关联方通过约定申报方式进行的使用固定期限费率的证券出借业务的情况。本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

**6.4.10.4.2 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**

本基金本报告期内及上年度可比期间，未发生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。本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 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区间基金管理人未持有本基金。本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

**6.4.10.5.2 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**

本报告期末及上年度末均未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。

**6.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年05月29日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	8,986,004.77	45,908.87	8,665,350.85	9,581.83

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司进行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他关联交易事项。本基金的基金合同生效日为2020年05月29日，上年度可比期间不完整。

#### 6.4.11 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。

#### 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年06月30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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年06月30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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金未参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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光大银行，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。

##### 6.4.13.2.1 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。

##### 6.4.13.2.2 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。

##### 6.4.13.2.3 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。

##### 6.4.13.2.4 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。

##### 6.4.13.2.5 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。

**6.4.13.2.6 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。

**6.4.13.3 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6.4.12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。

**6.4.13.3.1 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 2021年06 月30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	8,986,004.77	-	-	-	-	8,986,004.77
结算备付金	15,056.43	-	-	-	-	15,056.43
存出保证金	4,412.06	-	-	-	-	4,412.06
交易性金融资产	45,532,178.03	-	-	-	-	45,532,178.03
资产总计	54,537,651.29	-	-	-	-	54,537,651.29
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	54,537,651.29	-	-	-	-	54,537,651.29
上年度末 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	6,334,120.79	-	-	-	-	6,334,120.79
存出保证金	5,293.23	-	-	-	-	5,293.23
交易性金融资产	46,502,757.35	-	-	-	-	46,502,757.35
资产总计	52,842,171.37	-	-	-	-	52,842,171.37
负债	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	52,842,171.37	-	-	-	-	52,842,171.37

#### 6.4.13.3.2 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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
-----	-------	-------	--------	------	------	-----	----

浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021年 06月30 日							
资产							
银行存款	8,986,004.77	-	-	-	-	-	8,986,004.77
结算备付金	15,056.43	-	-	-	-	-	15,056.43
存出保证金	4,412.06	-	-	-	-	-	4,412.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	45,532,178.03	45,532,178.03
应收利息	-	-	-	-	-	3,059.56	3,059.56
应收申购款	-	-	-	-	-	5,789.07	5,789.07
资产总计	9,005,473.26	-	-	-	-	45,541,026.66	54,546,499.92
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	35,615.77	35,615.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	65,117.09	65,117.09
应付托管费	-	-	-	-	-	4,341.17	4,341.17
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,652.01	11,652.01
其他负债	-	-	-	-	-	146,019.57	146,019.57
负债总计	-	-	-	-	-	262,745.61	262,745.61
利率敏感度缺口	9,005,473.26	-	-	-	-	45,278,281.05	54,283,754.31
上年度 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	6,334,120.79	-	-	-	-	-	6,334,120.79
存出保证金	5,293.23	-	-	-	-	-	5,293.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	46,502,757.35	46,502,757.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-	762,661.75	762,661.75

应收利息	-	-	-	-	-	2,582.98	2,582.98
资产总计	6,339,414.02	-	-	-	-	47,268,002.08	53,607,416.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	196,194.43	196,194.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,889.99	64,889.99
应付托管费	-	-	-	-	-	4,326.00	4,326.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	720.63	720.63
其他负债	-	-	-	-	-	142,555.60	142,555.60
负债总计	-	-	-	-	-	408,686.65	408,686.65
利率敏感度缺口	6,339,414.02	-	-	-	-	46,859,315.43	53,198,729.45

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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	45,532,178.03	83.88	46,502,757.35	87.41
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	45,532,178.03	83.88	46,502,757.35	87.41

#### 6.4.13.4.3.2 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1、沪深300指数上涨5%	3,320,410.62	2,569,861.77
	2、沪深300指数下跌5%	-3,320,410.62	-2,569,861.77

## 6.4.13.4.4 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	风险价值	-1,521,509.51	-1,173,518.12
	合计	-1,521,509.51	-1,173,518.12

## 6.4.14 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。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 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	45,532,178.03	83.47
	其中：股票	45,532,178.03	83.47
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	9,001,061.20	16.50
8	其他各项资产	13,260.69	0.02
9	合计	54,546,499.92	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	43,783,249.95	80.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,120.48	0.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,596,527.00	2.94
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,544.00	0.02
J	金融业	71,681.10	0.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	39,055.50	0.07
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	45,532,178.03	83.88

### 7.2.2 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。

## 7.3 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	9,555	5,110,014.00	9.41
2	600436	片仔癀	10,800	4,841,640.00	8.92
3	600132	重庆啤酒	18,000	3,563,100.00	6.56
4	300760	迈瑞医疗	6,900	3,312,345.00	6.10
5	000568	泸州老窖	12,600	2,972,844.00	5.48
6	603899	晨光文具	34,800	2,942,688.00	5.42
7	603517	绝味食品	34,800	2,933,292.00	5.40
8	002311	海大集团	32,600	2,660,160.00	4.90
9	000661	长春高新	6,800	2,631,600.00	4.85
10	688169	石头科技	1,900	2,395,900.00	4.41
11	000858	五粮液	6,600	1,966,074.00	3.62
12	002242	九阳股份	57,300	1,861,677.00	3.43
13	300896	爱美客	2,160	1,703,980.80	3.14
14	300122	智飞生物	8,800	1,643,224.00	3.03
15	603288	海天味业	9,620	1,240,499.00	2.29
16	300957	贝泰妮	4,300	1,168,267.00	2.15
17	600827	百联股份	54,800	1,104,220.00	2.03
18	300601	康泰生物	4,400	655,600.00	1.21
19	000963	华东医药	10,700	492,307.00	0.91
20	605499	东鹏饮料	284	71,227.20	0.13
21	601665	齐鲁银行	4,895	45,523.50	0.08
22	601156	东航物流	1,650	39,055.50	0.07
23	600032	浙江新能	2,436	29,621.76	0.05
24	601528	瑞丰银行	1,680	26,157.60	0.05
25	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.04
26	001207	联科科技	512	16,952.32	0.03
27	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.03
28	605305	中际联合	294	15,470.28	0.03
29	605300	佳禾食品	547	15,206.60	0.03

30	603511	爱慕股份	414	13,662.00	0.03
31	001208	华菱线缆	1,403	10,845.19	0.02
32	603171	N税友	445	8,544.00	0.02
33	605011	N杭热	394	3,498.72	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	600132	重庆啤酒	2,434,937.00	4.58
2	688169	石头科技	2,425,304.24	4.56
3	600827	百联股份	1,886,418.00	3.55
4	603288	海天味业	1,450,383.00	2.73
5	300896	爱美客	1,099,600.00	2.07
6	300760	迈瑞医疗	1,099,061.00	2.07
7	300957	贝泰妮	984,357.00	1.85
8	000963	华东医药	521,286.00	0.98
9	300122	智飞生物	355,502.58	0.67
10	605090	九丰能源	28,796.81	0.05
11	601665	齐鲁银行	26,237.20	0.05
12	601156	东航物流	26,020.50	0.05
13	605296	神农集团	25,516.40	0.05
14	601528	瑞丰银行	13,641.60	0.03
15	605499	东鹏饮料	13,140.68	0.02
16	001206	依依股份	12,131.20	0.02
17	605339	南侨食品	11,291.70	0.02
18	605305	中际联合	11,154.36	0.02
19	003035	南网能源	10,789.80	0.02
20	605060	联德股份	10,320.58	0.02

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。

#### 7.4.2 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	600887	伊利股份	3,030,117.00	5.70
2	002475	立讯精密	2,638,515.52	4.96
3	600600	青岛啤酒	2,461,604.00	4.63
4	300529	健帆生物	1,829,736.16	3.44
5	600872	中炬高新	1,448,831.00	2.72
6	000895	双汇发展	1,264,710.00	2.38
7	002705	新宝股份	1,136,065.75	2.14
8	600827	百联股份	1,039,742.00	1.95
9	300146	汤臣倍健	1,002,590.00	1.88
10	600436	片仔癀	745,346.00	1.40
11	002557	洽洽食品	630,261.00	1.18
12	000858	五粮液	554,506.00	1.04
13	300750	宁德时代	553,630.00	1.04
14	000568	泸州老窖	539,475.00	1.01
15	601933	永辉超市	507,006.00	0.95
16	003035	南网能源	58,573.20	0.11
17	605339	南侨食品	31,521.00	0.06
18	605090	九丰能源	31,037.58	0.06
19	003040	楚天龙	27,509.98	0.05
20	605296	神农集团	26,635.70	0.05

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。

#### 7.4.3 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	12,657,587.30
卖出股票收入（成交）总额	19,975,549.66

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。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	4,412.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,059.56
5	应收申购款	5,789.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,260.69

### 7.12.4 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可转债。

### 7.12.5 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不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
389	84,965.70	0.00	0.000%	33,051,657.64	100.00 0%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末基金管理人的从业人员均未持有本基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年05月29日)基金份额总额	40,245,894.32
本报告期期初基金份额总额	36,222,988.71

本报告期基金总申购份额	1,823,320.64
减：本报告期基金总赎回份额	4,994,651.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	33,051,657.64

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

2021年6月18日，基金管理人增聘袁放先生、吴俊毅先生、胡长泉先生担任独立董事。

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。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为本基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	元数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
东吴证券	1	11,968,175.29	37.13%	8,512.28	36.48%	-
华创证券	1	2,470,739.62	7.67%	1,806.67	7.74%	-
浙商证券	2	17,793,483.57	55.20%	13,012.43	55.77%	-

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；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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本报告期内，本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 10.8 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关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）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	2021-01-05

2	浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-21
3	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下基金2020年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-01-21
4	浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金参与浙商证券股份有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-02-24
5	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与上海天天基金销售有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-08
6	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与上海中正达广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	2021-03-22
7	浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-30
8	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下基金2020年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-03-30
9	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下基金2021年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
10	浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
11	浙商汇金新兴消费灵活配置	中国证监会规定媒介	2021-05-27

	混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021定期更新）		
12	浙商汇金新兴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	中国证监会规定媒介	2021-05-27
13	浙江浙商证券资产管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021-06-19

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

关于准予浙商汇金大消费集合资产管理计划变更注册的批复；  
《浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；  
《浙商汇金新兴消费灵活配置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。

### 12.2 存放地点

基金管理人住所及托管人住所。

### 12.3 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  
二〇二一年八月三十日