

# 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

## 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:浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商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。

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                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料                              | 7  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| §4 管理人报告                                | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13 |
| 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                                | 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 14 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)                       | 14 |
| 6.1 资产负债表                               | 14 |
| 6.2 利润表                                 | 16 |
| 6.3 所有者权益(基金净值)变动表                      | 18 |
| 6.4 报表附注                                | 19 |
| §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                     | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 42 |
| 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      | 43 |
| 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   | 43 |
| 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   | 43 |
| 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      | 43 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 43 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 43 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 44 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 45 |

|   |    |
|---|----|
| 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.....   | 45 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                | 45 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 46 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 46 |
| 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.....   | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 47 |
| 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.....      | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 47 |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 50 |
| 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..... | 50 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 50 |
| §12 备查文件目录.....                         | 50 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 50 |
| 12.2 存放地点.....                          | 50 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 50 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                        |
|------------|------------------------|
| 基金名称       | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 浙商汇金聚鑫定开债              |
| 基金主代码      | 006927                 |
| 基金运作方式     | 契约型、定期开放式              |
| 基金合同生效日    | 2019年03月25日            |
| 基金管理人      | 浙江浙商证券资产管理有限公司         |
| 基金托管人      | 浙商银行股份有限公司             |
| 报告期末基金份额总额 | 1,187,925,987.41份      |
| 基金合同存续期    | 不定期                    |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。   |
| 投资策略 | <p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，结合国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况，综合分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产中的投资比率，构建和调整债券投资组合。</p> <p>2、债券投资组合策略</p> <p>在债券组合的构建和调整上，本基金综合运用久期配置、期限结构配置、类属资产配置、收益率曲线策略、杠杆放大策略等组合管理手段进行日常管理。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 信用债投资策略</p> <p>信用类债券是本基金重要投资标的，信用风险管理对于提高债券组合收益率至关重要。本基金将根据宏观经济运行状况、行业发展周期、公司业务状况、公司治理结构、财务状况等因素综合评估信用风险，确定信用类债券的信用风险利差，有效管理组合的整</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>体信用风险。同时，本基金将运用本基金管理人比较完善的信用债券评级体系，研究和跟踪发行主体所属行业发展周期、业务状况、公司治理结构、财务状况等因素，综合评估发行主体信用风险，确定信用产品的信用风险利差，有效管理组合的整体信用风险。</p> <p>(2) 可转换债券投资策略</p> <p>基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析，并结合市场环境情况等，本基金在一、二级市场投资可转换债券，以达到在严格控制风险的基础上，实现基金资产稳健增值的目的。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>对于资产支持证券，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，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选择风险调整收益高的品种进行投资。本基金将严格控制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>(二) 开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、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 | 浙商银行股份有限公司         |
| 信息披露负责人 | 姓名             | 方斌                 |
|         | 联系电话           | 0571-87903297      |
|         | 电子邮箱           | fund@stocke.com.cn |
| 客户服务电话  | 95345          | 95527              |

|       |                           |                |
|-------|---------------------------|----------------|
| 传真    | 0571-87902581             | 0571-88268688  |
| 注册地址  | 杭州市拱墅区天水巷25号              | 杭州市萧山区鸿宁路1788号 |
| 办公地址  | 杭州市上城区五星路201号浙<br>商证券大楼7楼 | 杭州市延安路368号     |
| 邮政编码  | 310020                    | 310006         |
| 法定代表人 | 盛建龙                       | 沈仁康            |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                       |
|---------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报                  |
| 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 | 浙江浙商证券资产管理有限公司 | 杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼7楼 |

## § 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<br>(2021年01月01日- 2021年06月30日) |
|---------------|-----------------------------------|
|               | 本期已实现收益                           |
| 本期利润          | 12,331,909.92                     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0171                            |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.69%                             |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.64%                             |
| 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            | 6,928,043.33          |
| 期末可供分配基金份额利润        | 0.0058                |
| 期末基金资产净值            | 1,206,213,706.90      |
| 期末基金份额净值            | 1.0154                |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | 报告期末<br>(2021年06月30日) |
| 基金份额累计净值增长率         | 7.95%                 |

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      | 0.20%    | 0.02%       | -0.04%     | 0.03%         | 0.24% | -0.01% |
| 过去三个月      | 1.07%    | 0.02%       | 0.45%      | 0.03%         | 0.62% | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.64%    | 0.03%       | 0.65%      | 0.04%         | 0.99% | -0.01% |
| 过去一年       | 2.64%    | 0.04%       | -0.20%     | 0.06%         | 2.84% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.95%    | 0.05%       | 1.53%      | 0.07%         | 6.42% | -0.02% |

注：本基金业绩比较基准：中债综合全价指数收益率。

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



浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年03月25日-2021年06月30日)



## § 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 |        |   |
| 王宇超 | 本基金基金经理, 浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、浙商汇金短债债券型证券投资基金基金经理、浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、浙商汇金聚盈中短债债券型证券投资基金基金经理、浙商汇金聚泓两年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理及浙商汇金安享66个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。 | 2020-08-11      | -    | 5年     | 中国国籍，硕士。2020年2月加入浙江浙商证券资产管理有限公司，2年信用研究经验，5年固定收益投资管理经验。曾任渣打银行企业信用分析师，海通证券投资经理助理及投资经理，目前担任公司公募固定收益投资部基金经理。擅长并长期对产业和公司信用状况进行研究，结合定量和定性的方法度量企业偿债能力，并拥有丰富的利率债交易经验。2020年8月起担任浙商汇金短债债券型证券投资基金、浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、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、浙商汇金聚禄一年定 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 期开放债券型证券投资基金、浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020年9月起任浙商汇金安享66个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020年11月起任浙商汇金聚泓两年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：上述表格内基金经理的任职日期、离职日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写。证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 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

一月末央行通过公开市场操作收紧流动性，跨年行情迅速结束。之后长端收益率美债长端收益快速上行的压力下，继续上行。二月短端收益率在银行结构性存款增加及市场主动降杠杆的情况下有所回落，但6个月以上期限同业存单价格持续上行。侧面体现出在实体融资需求旺盛的背景下，银行对中长期期限负债需求持续提升压力边际提高。三月初债券市场交易主线不是非常很明朗，但十年国债始终没能突破3.28阻力位向上。当月不是缴税大月，且财政支出较多，因此在央行没有净投放的情况下，流动性依然维持偏松的格局。事实上三月金融及经济数据都是超预期优秀，但市场基本未对这些强势数据做出太大反应。反而三月中旬，伴随股市下跌带来的资金流入银行理财及货币基金压制了同业存单价格收益率向上的趋势，部分对冲了同业存单到期量逐渐增大及地方债开始密集发行的供给压力。同时，在中美谈判较为激烈的影响下长端收益率率先下行。长端利率在3月末跨季资金全面放松的情况下开始窄幅震荡。

回顾4、5月，基本面修复放缓已是市场共识，央行暂时并没有对通胀有所担忧，美元走弱导致人民币被动升值，也可以部分对冲上游价格提升，收益率保持下行趋势。表现最好的是超长期利率，5-10年同期限国债表现优于国开，5年以内期限则为国开表现更优。而6月整月在资金面震荡的格局下，各期限利率债收益波动不大。但超长端利率在险资配置情绪不高，计划发行次数增加的情况下遭到交易盘砸盘，因此表现较差，基本上回吐了5月的涨幅。6月市场的整体矛盾集中于跨季资金面波动，因为无论从债市还是股市都可以看到目前市场对未来经济增长以及海外节奏等宏观环境有较大分歧，所以债市方面期限利差持续保持较高位置，股市是行业板块轮动速度飞快。

当下，全球对通胀的容忍度在提高，而内生稳增长的压力逐渐增强，考虑到债务压力，货币政策保持稳定的可能性较大。4季度的政治局会议也明确“要用好稳增长压力较小的窗口期”，并且央行6月末表示表态无需对流动性进行不必要的猜测，因此只要基本面没有出现失速的情况，今年主题仍然在于降低宏观杠杆率。并且央行也在七月上旬进行了降准对冲到期MLF的操作，保证了短期内银行间流动性的充裕。至于海外流动性的收紧，鉴于目前人民币汇率处于较高位置，后续看即使美元持续走强，央行可能会选择市场化处理汇率问题而不是通过公开市场操作来控制汇率，对债市带来的影响有限。另一方面6月末pmi分项中出口订单指数连续三个月下滑，原材料购进指数也有较大幅度回落，叠加房地产投资放缓已成事实，的确是存在动能放缓的情况。

但值得关注的是二季度债市已经将基本面复苏节奏减缓的预期打得较满，局部信用收缩带来的配置需求也将高等级信用利差压缩到历史低位。虽然三季度货币政策收紧可

能性不大，但后续如果社融增速放缓速度较快，是否会发生财政部进行地方债放量发行来对冲对经济下行的压力。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商汇金聚鑫定开债基金份额净值为1.0154元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.64%，同期业绩比较基准收益率为0.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，鉴于6月底财政部刚印发了《地方政府专项债券项目资金绩效管理办法》，短期内专项债发行提速可能持续受限。因此七月策略还是保持久期中性策略，跟随资金面的波动参与长端利率波段交易，增厚账户收益。局部紧信用导致存续资产的信用利差持续保持在低位，因此信用方面也应该在资金面收紧的时候寻求一二级套利机会。但八九月份要谨防供给放量给资金面带来的冲击，及通胀在海外需求不降的情况下再次抬头，带动收益率水平回调。

#### 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

根据相关法律法规及《浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

本基金对报告期内利润共进行1次收益分配。于2021年06月10日，每10份基金份额派发红利0.10元，共计派发红利6,946,357.35元。

#### 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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金的管理人—浙江浙商证券资产管理有限公司在浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金进行利润分配6,946,357.35元。

#### 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

本托管人依法对浙江浙商证券资产管理有限公司编制和披露的浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金2021年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

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 | 上年度末 |
|----|-----|-----|------|
|----|-----|-----|------|

|                 |            | 2021年06月30日                | 2020年12月31日                 |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                            |                             |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 892,785.06                 | 580,817.28                  |
| 结算备付金           |            | 4,108,695.45               | -                           |
| 存出保证金           |            | 3,683.28                   | -                           |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 1,256,477,368.00           | 790,450,975.40              |
| 其中：股票投资         |            | -                          | -                           |
| 基金投资            |            | -                          | -                           |
| 债券投资            |            | 1,256,477,368.00           | 790,450,975.40              |
| 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    | 168,521,612.80             | 13,480,260.22               |
| 应收证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 16,147,561.19              | 13,068,718.18               |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 1,446,151,705.78           | 817,580,771.08              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>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       |            | 239,494,390.00             | 116,249,625.62              |
| 应付证券清算款         |            | 1,923.29                   | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 207,087.07                 | 182,269.33                  |

|               |          |                  |                |
|---------------|----------|------------------|----------------|
| 应付托管费         |          | 69,029.04        | 60,756.44      |
| 应付销售服务费       |          | -                | -              |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 46,576.03        | 18,172.46      |
| 应交税费          |          | -                | -              |
| 应付利息          |          | 38,410.44        | 78,292.90      |
| 应付利润          |          | -                | -              |
| 递延所得税负债       |          | -                | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 80,583.01        | 162,500.00     |
| 负债合计          |          | 239,937,998.88   | 116,751,616.75 |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,187,925,987.41 | 694,635,734.84 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 18,287,719.49    | 6,193,419.49   |
| 所有者权益合计       |          | 1,206,213,706.90 | 700,829,154.33 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,446,151,705.78 | 817,580,771.08 |

注：报告截止日2021年06月30日，浙商汇金聚鑫定开债基金份额净值1.0154元，基金份额总额1,187,925,987.41份。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

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<br>2021年01月01日至<br>2021年06月30日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至202<br>0年06月30日 |
|-------------|----------|-----------------------------------|--|
| <b>一、收入</b> |          | 15,623,349.95                     | 5,489,274.28                           |
| 1. 利息收入     |          | 14,091,902.21                     | 13,671,844.04                          |
| 其中：存款利息收入   | 6.4.7.11 | 20,366.05                         | 32,831.59                              |
| 债券利息收入      |          | 12,796,284.84                     | 11,663,578.34                          |
| 资产支持证券利息收入  |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产    |          | 1,275,251.32                      | 1,975,434.11                           |



|                        |                |               |               |
|------------------------|----------------|---------------|---------------|
| 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）      |                | -1,747,572.73 | -1,175,854.68 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12       | -             | -             |
| 基金投资收益                 | 6.4.7.13       | -             | -             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.14       | -1,747,572.73 | -1,175,854.68 |
| 资产支持证券投资<br>收益         | 6.4.7.14.<br>3 | -             | -             |
| 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       | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18       | 3,279,020.47  | -7,006,715.08 |
| 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       | -             | -             |
| <b>减：二、费用</b>          |                | 3,291,440.03  | 3,110,454.17  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.<br>1 | 1,081,466.84  | 995,301.20    |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.<br>2 | 360,488.98    | 331,767.00    |
| 3. 销售服务费               |                | -             | -             |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.20       | 15,188.61     | 9,546.15      |
| 5. 利息支出                |                | 1,735,112.59  | 1,674,430.12  |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出      |                | 1,735,112.59  | 1,674,430.12  |
| 6. 税金及附加               |                | -             | 3.52          |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.21       | 99,183.01     | 99,406.18     |
| <b>三、利润总额（亏损总额</b>     |                | 12,331,909.92 | 2,378,820.11  |

|                   |  |               |              |
|-------------------|--|---------------|--------------|
| 以“-”号填列)          |  |               |              |
| 减：所得税费用           |  | -             | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列) |  | 12,331,909.92 | 2,378,820.11 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

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<br>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)                        | 694,635,734.84                     | 6,193,419.49  | 700,829,154.33   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                  | 12,331,909.92 | 12,331,909.92    |
| 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)      | 493,290,252.57                     | 6,708,747.43  | 499,999,000.00   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 493,290,252.57                     | 6,708,747.43  | 499,999,000.00   |
| 2. 基金赎回款                               | -                                  | -             | -                |
| 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) | -                                  | -6,946,357.35 | -6,946,357.35    |
| 五、期末所有者权益（基金净值)                        | 1,187,925,987.41                   | 18,287,719.49 | 1,206,213,706.90 |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>2020年01月01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<br>(基金净值)                                    | 509,999,097.23 | 8,471,415.91   | 518,470,513.14   |
| 二、本期经营活动产生<br>的基金净值变动<br>数(本期利润)                       | -              | 2,378,820.11   | 2,378,820.11     |
| 三、本期基金份额交<br>易产生的基金净值<br>变动数(净值减少以<br>“-”号填列)          | 484,636,037.61 | 15,362,962.39  | 499,999,000.00   |
| 其中: 1. 基金申购款   | 484,636,037.61 | 15,362,962.39  | 499,999,000.00   |
| 2. 基金赎回<br>款   | -              | -              | -                |
| 四、本期向基金份额<br>持有人分配利润产<br>生的基金净值变动<br>(净值减少以“-”<br>号填列) | -              | -10,199,981.94 | -10,199,981.94   |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                    | 994,635,134.84 | 16,013,216.47  | 1,010,648,351.31 |

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

浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2018]1724号《关于准予浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》批准,由浙江浙商证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》向社会公开发行人募集。《浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2019年3月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为509,999,097.23份。

相关募集业经北京兴华会计师事务所[2019]京会兴浙分验字第68000010号验资报告予以验证。本基金为债券型证券投资基金，存续期限不定。基金管理人为浙江浙商证券资产管理有限公司，注册登记机构为浙江浙商证券资产管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

#### 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《浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式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01月01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         | 892,785.06  |  |
| 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           | 892,785.06  |  |

#### 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            | -                | -                | -                |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                | -                | -                |               |
| 债券            | 交易所市场            | 64,224,882.83    | 64,422,368.00    | 197,485.17    |
|               | 银行间市场            | 1,195,244,885.70 | 1,192,055,000.00 | -3,189,885.70 |
|               | 合计               | 1,259,469,768.53 | 1,256,477,368.00 | -2,992,400.53 |
| 资产支持证券        | -                | -                | -                |               |
| 基金            | -                | -                | -                |               |
| 其他            | -                | -                | -                |               |
| 合计            | 1,259,469,768.53 | 1,256,477,368.00 | -2,992,400.53    |               |

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                  | -         |
| 银行间市场 | 168,521,612.80     | -         |
| 合计    | 168,521,612.80     | -         |

#### 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<br>2021年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 3,233.31           |
| 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  | 1,848.90           |
| 应收债券利息     | 16,030,033.19      |
| 应收资产支持证券利息 | -                  |
| 应收买入返售证券利息 | 112,444.09         |
| 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         | 1.70               |
| 合计         | 16,147,561.19      |

#### 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<br>2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                  |
| 银行间市场应付交易费用 | 46,576.03          |
| 合计          | 46,576.03          |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | -                  |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 预提费用        | 80,583.01          |
| 合计          | 80,583.01          |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 694,635,734.84                | 694,635,734.84   |
| 本期申购          | 493,290,252.57                | 493,290,252.57   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                             | -                |
| 本期末           | 1,187,925,987.41              | 1,187,925,987.41 |

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           | 2,251,757.98  | 3,941,661.51  | 6,193,419.49  |
| 本期利润           | 9,052,889.45  | 3,279,020.47  | 12,331,909.92 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,569,753.25  | 4,138,994.18  | 6,708,747.43  |
| 其中：基金申购款       | 2,569,753.25  | 4,138,994.18  | 6,708,747.43  |
| 基金赎回款          | -             | -             | -             |
| 本期已分配利润        | -6,946,357.35 | -             | -6,946,357.35 |
| 本期末            | 6,928,043.33  | 11,359,676.16 | 18,287,719.49 |

#### 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  | 13,382.54               |
| 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 | 6,974.41                |
| 其他        | 9.10                    |
| 合计        | 20,366.05               |

注：其他为结算保证金应收利息。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期末未进行股票投资。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金在本报告期末未进行基金投资。

#### 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

单位：人民币元

| 项目 | 本期                      |
|----|-------------------------|
|    | 2021年01月01日至2021年06月30日 |

|                               |               |
|-------------------------------|---------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -1,747,572.73 |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -             |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -             |
| 合计                            | -1,747,572.73 |

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                      |
|-------------------------|-------------------------|
|                         | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 474,130,142.85          |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 468,820,426.78          |
| 减：应收利息总额                | 7,057,288.80            |
| 买卖债券差价收入                | -1,747,572.73           |

#### 6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未进行资产支持证券投资。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期未进行贵金属投资。

#### 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

本基金本报告期未进行权证投资。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未进行其他衍生工具投资。

#### 6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 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             | 3,279,020.47            |
| ——股票投资                 | -                       |
| ——债券投资                 | 3,279,020.47            |
| ——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                     | 3,279,020.47            |

#### 6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 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 | 26.11                   |
| 银行间市场交易费用 | 15,162.50               |
| 合计        | 15,188.61               |

#### 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    | 21,075.64               |
| 信息披露费   | 59,507.37               |
| 证券出借违约金 | -                       |
| 帐户维护费   | 18,000.00               |
| 其他      | 600.00                  |
| 合计      | 99,183.01               |

#### 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 |
| 浙商银行股份有限公司     | 基金托管人、本基金销售机构       |
| 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   |

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

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股票交易。

#### 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。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称              | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |                                | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |                                |
|--------------------|-------------------------------|--------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|
|                    | 成交金额                          | 占当期<br>债券买<br>卖成交<br>总额的<br>比例 | 成交金额                               | 占当期<br>债券买<br>卖成交<br>总额的<br>比例 |
| 浙商证券<br>股份有限<br>公司 | 26,058,869.80                 | 100.00%                        | 192,451,553.90                     | 100.00%                        |

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称              | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |                                | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |                                |
|--------------------|-------------------------------|--------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|
|                    | 成交金额                          | 占当期<br>债券回<br>购成交<br>总额的<br>比例 | 成交金额                               | 占当期<br>债券回<br>购成交<br>总额的<br>比例 |
| 浙商证券<br>股份有限<br>公司 | 1,776,400,000.00              | 100.00%                        | 1,330,000,000.00                   | 100.00%                        |

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间内，无应支付关联方的佣金。本报告期末及上年度末无应付关联方佣金余额。

#### 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<br>2021年01月01日至2021年06月30日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,081,466.84                  | 995,301.20                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                             | 364,921.96                         |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 360,488.98                    | 331,767.00                         |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间内，均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易的情况。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间内，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。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间内，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。

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2021年01月01日至<br>2021年06月30日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至<br>2020年06月30日 |
|---------------------|-----------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额         | 10,000,097.23                     | 10,000,097.23                          |
| 报告期间申购/买入总份额        | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期间因拆分变动份额         | 0.00                              | 0.00                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额         | 10,000,097.23                     | 10,000,097.23                          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.84%                             | 1.01%                                  |

注：1、上表列示的报告期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，列示的报告期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、本报告期内，基金管理人运用自有资金投资本基金费率与其他投资者执行的费率一致，基金管理人赎回本基金份额的行为遵从《基金管理公司自有资金运用管理暂行规定》的相关规定。

##### 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

在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<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |           | 上年度可比期间<br>2020年01月01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    |
| 浙商银行股份有限公司 | 892,785.06                    | 13,382.54 | 828,736.00                         | 20,520.97 |

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内，均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间内，均未发生其他关联交易事项。

#### 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

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日        | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额     | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计     | 备注 |
|----|------------|------------|-------------|--------------|-----------|--------------|----|
| 1  | 2021-06-10 | 2021-06-10 | 0.100       | 6,946,357.35 | -         | 6,946,357.35 | -  |
| 合计 |            |            | 0.100       | 6,946,357.35 | -         | 6,946,357.35 | -  |

#### 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为219,994,390.00元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称   | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|--------|--------|------------|--------|-----------|----------------|
| 150218 | 15国开18 | 2021-07-06 | 101.96 | 200,000   | 20,392,000.00  |
| 180204 | 18国开04 | 2021-07-01 | 103.13 | 421,000   | 43,417,730.00  |
| 180211 | 18国开11 | 2021-07-06 | 101.76 | 145,000   | 14,755,200.00  |
| 190207 | 19国开07 | 2021-07-06 | 100.60 | 600,000   | 60,360,000.00  |
| 200203 | 20国开03 | 2021-07-06 | 100.33 | 200,000   | 20,066,000.00  |
| 200303 | 20进出03 | 2021-07-06 | 98.90  | 300,000   | 29,670,000.00  |
| 210205 | 21国开05 | 2021-07-06 | 101.25 | 400,000   | 40,500,000.00  |
| 合计     |        |            |        | 2,266,000 | 229,160,930.00 |

#### 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，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为19,500,000.00元，于2021年07月01日到期。该类交易要求本基金回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 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

本基金管理人按照全面风险管理的要求，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

公司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浙商银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 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无短期信用评级列示的债券投资。

##### 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无短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年06月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 572,769,000.00     | 229,664,000.00      |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 498,980,368.00     | 403,846,975.40      |
| 合计     | 1,071,749,368.00   | 633,510,975.40      |

注：本表债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示的为利率债。

#### 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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年06月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 184,728,000.00     | 156,940,000.00      |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | 184,728,000.00     | 156,940,000.00      |

注：本表主要列示同业存单，评级取自第三方评级机构的主体评级。

#### 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<br>2021年06<br>月30日 | 1个月以<br>内    | 1-3个月 | 3个月<br>-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 合计           |
|------------------------|--------------|-------|------------|------|------|--------------|
| 资产                     | -            | -     | -          | -    | -    |              |
| 银行存款                   | 892,785.06   | -     | -          | -    | -    | 892,785.06   |
| 结算备付金                  | 4,108,695.45 | -     | -          | -    | -    | 4,108,695.45 |
| 存出保证金                  | 3,683.28     | -     | -          | -    | -    | 3,683.28     |

|                         |                        |                   |                        |                        |                        |                      |
|-------------------------|------------------------|-------------------|------------------------|------------------------|------------------------|----------------------|
| 交易性金融资产                 | -                      | -                 | 369,78<br>5,368.0<br>0 | 785,79<br>8,000.0<br>0 | 100,89<br>4,000.0<br>0 | 1,256,477,368.<br>00 |
| 买入返售金融资产                | 168,52<br>1,612.8<br>0 | -                 | -                      | -                      | -                      | 168,521,612.80       |
| 资产总计                    | 173,52<br>6,776.5<br>9 | -                 | 369,78<br>5,368.0<br>0 | 785,79<br>8,000.0<br>0 | 100,89<br>4,000.0<br>0 | 1,430,004,144.<br>59 |
| 负债                      | -                      | -                 | -                      | -                      | -                      |                      |
| 卖出回购金融资产款               | 239,49<br>4,390.0<br>0 | -                 | -                      | -                      | -                      | 239,494,390.00       |
| 负债总计                    | 239,49<br>4,390.0<br>0 | -                 | -                      | -                      | -                      | 239,494,390.00       |
| 流动性净额                   | -65,96<br>7,613.4<br>1 | -                 | 369,78<br>5,368.0<br>0 | 785,79<br>8,000.0<br>0 | 100,89<br>4,000.0<br>0 | 1,190,509,754.<br>59 |
| 上年度末<br>2020年12<br>月31日 | 1个月以<br>内              | 1-3个月             | 3个月<br>-1年             | 1-5年                   | 5年以上                   | 合计                   |
| 资产                      | -                      | -                 | -                      | -                      | -                      |                      |
| 银行存款                    | 580,81<br>7.28         | -                 | -                      | -                      | -                      | 580,817.28           |
| 交易性金融资产                 | -                      | 19,866,<br>000.00 | 267,89<br>8,000.0<br>0 | 493,08<br>7,975.4<br>0 | 9,599,0<br>00.00       | 790,450,975.40       |
| 买入返售金融资产                | 13,480,<br>260.22      | -                 | -                      | -                      | -                      | 13,480,260.22        |
| 资产总计                    | 14,061,<br>077.50      | 19,866,<br>000.00 | 267,89<br>8,000.0<br>0 | 493,08<br>7,975.4<br>0 | 9,599,0<br>00.00       | 804,512,052.90       |

|                   |                         |                   |                        |                        |                  |                |
|-------------------|-------------------------|-------------------|------------------------|------------------------|------------------|----------------|
| 负债                | -                       | -                 | -                      | -                      | -                |                |
| 卖出回购<br>金融资产<br>款 | 116,24<br>9,625.6<br>2  | -                 | -                      | -                      | -                | 116,249,625.62 |
| 负债总计              | 116,24<br>9,625.6<br>2  | -                 | -                      | -                      | -                | 116,249,625.62 |
| 流动性净<br>额         | -102,18<br>8,548.1<br>2 | 19,866,<br>000.00 | 267,89<br>8,000.0<br>0 | 493,08<br>7,975.4<br>0 | 9,599,0<br>00.00 | 688,262,427.28 |

#### 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。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021年<br>06月30<br>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                        | 892,785.06 | -     | -      | -    | -    | -   | 892,785.06 |

浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年中期报告

|                             |                |               |                |                |                |               |                  |
|-----------------------------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 款                           |                |               |                |                |                |               |                  |
| 结算备付金                       | 4,108,695.45   | -             | -              | -              | -              | -             | 4,108,695.45     |
| 存出保证金                       | 3,683.28       | -             | -              | -              | -              | -             | 3,683.28         |
| 交易性金融资产                     | -              | -             | 369,785,368.00 | 785,798,000.00 | 100,894,000.00 | -             | 1,256,477,368.00 |
| 买入返售金融资产                    | 168,521,612.80 | -             | -              | -              | -              | -             | 168,521,612.80   |
| 应收利息                        | -              | -             | -              | -              | -              | 16,147,561.19 | 16,147,561.19    |
| 资产总计                        | 173,526,776.59 | -             | 369,785,368.00 | 785,798,000.00 | 100,894,000.00 | 16,147,561.19 | 1,446,151,705.78 |
| 负债                          |                |               |                |                |                |               |                  |
| 卖出回购金融资产款                   | 239,494,390.00 | -             | -              | -              | -              | -             | 239,494,390.00   |
| 应付证券清算款                     | -              | -             | -              | -              | -              | 1,923.29      | 1,923.29         |
| 应付管理人报酬                     | -              | -             | -              | -              | -              | 207,087.07    | 207,087.07       |
| 应付托管费                       | -              | -             | -              | -              | -              | 69,029.04     | 69,029.04        |
| 应付交易费用                      | -              | -             | -              | -              | -              | 46,576.03     | 46,576.03        |
| 应付利息                        | -              | -             | -              | -              | -              | 38,410.44     | 38,410.44        |
| 其他负债                        | -              | -             | -              | -              | -              | 80,583.01     | 80,583.01        |
| 负债总计                        | 239,494,390.00 | -             | -              | -              | -              | 443,608.88    | 239,937,998.88   |
| 利率敏感度缺口                     | -65,967,613.41 | -             | 369,785,368.00 | 785,798,000.00 | 100,894,000.00 | 15,703,952.31 | 1,206,213,706.90 |
| 上年度末<br>2020年<br>12月31<br>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                        | 580,817.28     | -             | -              | -              | -              | -             | 580,817.28       |
| 交易性金融资产                     | -              | 19,866,000.00 | 267,898,000.00 | 493,087,975.40 | 9,599,000.00   | -             | 790,450,975.40   |
| 买入返售金融                      | 13,480,260.22  | -             | -              | -              | -              | -             | 13,480,260.22    |

|           |                 |               |                |                |              |               |                |
|-----------|-----------------|---------------|----------------|----------------|--------------|---------------|----------------|
| 资产        |                 |               |                |                |              |               |                |
| 应收利息      | -               | -             | -              | -              | -            | 13,068,718.18 | 13,068,718.18  |
| 资产总计      | 14,061,077.50   | 19,866,000.00 | 267,898,000.00 | 493,087,975.40 | 9,599,000.00 | 13,068,718.18 | 817,580,771.08 |
| 负债        |                 |               |                |                |              |               |                |
| 卖出回购金融资产款 | 116,249,625.62  | -             | -              | -              | -            | -             | 116,249,625.62 |
| 应付管理人报酬   | -               | -             | -              | -              | -            | 182,269.33    | 182,269.33     |
| 应付托管费     | -               | -             | -              | -              | -            | 60,756.44     | 60,756.44      |
| 应付交易费用    | -               | -             | -              | -              | -            | 18,172.46     | 18,172.46      |
| 应付利息      | -               | -             | -              | -              | -            | 78,292.90     | 78,292.90      |
| 其他负债      | -               | -             | -              | -              | -            | 162,500.00    | 162,500.00     |
| 负债总计      | 116,249,625.62  | -             | -              | -              | -            | 501,991.13    | 116,751,616.75 |
| 利率敏感度缺口   | -102,188,548.12 | 19,866,000.00 | 267,898,000.00 | 493,087,975.40 | 9,599,000.00 | 12,566,727.05 | 700,829,154.33 |

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

|    |  |                                 |                     |
|----|--|---------------------------------|---------------------|
| 假设 | 1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额； |                                 |                     |
| 假设 | 2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化；                         |                                 |                     |
| 假设 | 3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。                             |                                 |                     |
| 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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |  | 本期末<br>2021年06月30日              | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|    | 1、利率下降25个基点  | 2,300,605.10                    | 3,117,805.51        |
|    | 2、利率上升25个基点  | -2,291,874.11                   | -3,091,048.78       |

#### 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。

##### 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<br>2021年06月30日 |                          | 上年度末<br>2020年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资产—债券投资  | 1,256,477,368.00   | 104.17                   | 790,450,975.40      | 112.79                   |
| 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            | 1,256,477,368.00   | 104.17                   | 790,450,975.40      | 112.79                   |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。



#### 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60天  |                    |                     |
| 分析 | 风险价值     | 本期末<br>2021年06月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|    | 风险价值     | -574,368.20        | -344,721.33         |
|    | 合计       | -574,368.20        | -344,721.33         |

#### 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              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,256,477,368.00 | 86.88         |
|    | 其中：债券             | 1,256,477,368.00 | 86.88         |
|    | 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          | 168,521,612.80   | 11.65         |
|    | 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      | 5,001,480.51     | 0.35          |
| 8  | 其他各项资产            | 16,151,244.47    | 1.12          |
| 9  | 合计                | 1,446,151,705.78 | 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

本基金本报告期末未持有境内股票投资组合。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期内未买入股票。

### 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

本基金本报告期内未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票买卖。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 20,272,000.00    | 1.68         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,051,477,368.00 | 87.17        |
|    | 其中：政策性金融债 | 478,708,368.00   | 39.69        |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债(可交换债) | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | 184,728,000.00   | 15.31        |

|    |    |                  |        |
|----|----|------------------|--------|
| 9  | 其他 | -                | -      |
| 10 | 合计 | 1,256,477,368.00 | 104.17 |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码    | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 180204  | 18国开04   | 600,000 | 61,878,000.00 | 5.13         |
| 2  | 210205  | 21国开05   | 600,000 | 60,750,000.00 | 5.04         |
| 3  | 2028029 | 20交通银行01 | 600,000 | 60,372,000.00 | 5.01         |
| 4  | 190207  | 19国开07   | 600,000 | 60,360,000.00 | 5.00         |
| 5  | 2028054 | 20华夏银行   | 500,000 | 50,595,000.00 | 4.19         |

## 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证券中，没有超出基金合同规定的备选证券库之外的证券。

### 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   | 3,683.28      |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 16,147,561.19 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 16,151,244.47 |

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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<br>(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 |
| 2            | 593,962,993.71 | 1,187,925,987.41 | 100.000% | 0.00  | 0.000% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺 |
|----|--------|--------------|--------|--------------|--------|
|    |        |              |        |              |        |

|             |               |       |               |       |      |
|-------------|---------------|-------|---------------|-------|------|
|             |               |       |               |       | 持有期限 |
| 基金管理人固有资金   | 10,000,097.23 | 0.84% | 10,000,097.23 | 0.84% | 3年   |
| 基金管理人高级管理人员 | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -    |
| 基金经理等人员     | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -    |
| 基金管理人股东     | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -    |
| 其他          | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -    |
| 合计          | 10,000,097.23 | 0.84% | 10,000,097.23 | 0.84% | 3年   |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2019年03月25日)基金份额总额 | 509,999,097.23   |
| 本报告期期初基金份额总额               | 694,635,734.84   |
| 本报告期基金总申购份额                | 493,290,252.57   |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 1,187,925,987.41 |

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 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国泰君安 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 浙商证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

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、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|------|---------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 国泰君安 | -             | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 浙商证券 | 26,058,869.80 | 100.00%      | 1,776,400,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

### 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  | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金2020年第四季度报告               | 中国证监会规定媒介 | 2021-01-21 |
| 2  | 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 |
| 3  | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告             | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-04 |
| 4  | 关于浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金增加侧袋机制并相应修订基金合同及托管协议的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-25 |



|    |   |           |            |
|----|---|-----------|------------|
| 5  | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议                        | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-25 |
| 6  | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同                        | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-25 |
| 7  | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2021年第1次重大事项临时更新） | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-25 |
| 8  | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式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 | 2021-03-25 |
| 9  | 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 |
| 10 | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金2020年年度报告                   | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-30 |
| 11 | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金2021年第一季度报告                 | 中国证监会规定媒介 | 2021-04-21 |
| 12 | 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 |
| 13 | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金2021年第一次分红公告                | 中国证监会规定媒介 | 2021-06-08 |
| 14 | 浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告               | 中国证监会规定媒介 | 2021-06-09 |
| 15 | 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 |

|  |   |  |  |
|--|---|--|--|
|  | 告 |  |  |
|--|---|--|--|

## § 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

| 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   |
| 机构  | 1              | 20210101-20210630      | 684,635,637.61 | 493,290,252.57 | 0.00       | 1,177,925,890.18 | 99.16% |
| 产品特有风险  |                |                        |                |                |            |                  |        |
| <p>报告期内，本基金发起资金持有份额比例超过基金总份额的20%且持有比例较大，除本基金招募说明书中列示的各项风险情形外，还包括因该类投资者巨额赎回可能导致的基金清盘风险、流动性风险和基金净值波动风险。</p> <p>根据基金合同及相关法律法规约定，自基金成立之日起，基金管理人的发起资金持有基金份额不得少于3年，报告期内，本基金未发生上述相关风险事项。</p> |                |                        |                |                |            |                  |        |

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

### 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

中国证监会批准设立浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金的文件；  
《浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；  
《浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式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。

浙江浙商证券资产管理有限公司  
二〇二一年八月三十日