

# 浙商汇金双月鑫 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 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:兴业银行股份有限公司

送出日期:2022 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年04月19日（基金合同生效日）起至2022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	6
2.5 其他相关资料	6
§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	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	13
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	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53

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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金	
基金简称	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债	
基金主代码	014490	
基金运作方式	契约型开放式；本基金对于每份基金份额，设定60天的滚动运作期。	
基金合同生效日	2022年04月19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	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	310,412,738.28份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C
下属分级基金的交易代码	014490	014491
报告期末下属分级基金的份额总额	62,960,170.25份	247,452,568.03份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过重点投资中短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将在有效管理风险、保持资产较高流动性的基础上，实现超过比较基准的稳定回报。本基金的投资策略包括资产配置策略、债券投资组合策略、信用债投资策略、资产支持证券投资策略和国债期货交易策略等。
业绩比较基准	中债综合财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金属于“中低风险”品种，为债券型基金，一般市场情况下，长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

注：本基金暂仅向个人投资者（含公募资产管理产品）发售，具体发售对象以基金份额发售公告或相关公告为准。如未来本基金对发售对象的范围予以调整，基金管理人在履行适当程序后进行公告。

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	楼小平	李真
	联系电话	0571-87903297	021-52629999-212051
	电子邮箱	fund@stocke.com.cn	tgb_lizhen@cib.com.cn
客户服务电话		95345	95561
传真		0571-87902581	021-62159217
注册地址		浙江省杭州市拱墅区天水巷25号	上海市银城路167号兴业大厦4楼
办公地址		浙江省杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼7楼	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
邮政编码		310020	200120
法定代表人		盛建龙	吕家进

### 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	浙江省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	浙江省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 (2022年04月19日(基金合同生效日)-2022年06月30日)	
	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债 A	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债 C
本期已实现收益	585,581.23	2,552,976.59
本期利润	566,557.06	2,473,897.21
加权平均基金份额本期利润	0.0066	0.0064
本期加权平均净值利润率	0.65%	0.64%
本期基金份额净值增长率	0.64%	0.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	403,640.31	1,540,744.51
期末可供分配基金份额利润	0.0064	0.0062
期末基金资产净值	63,363,810.56	248,993,312.54
期末基金份额净值	1.0064	1.0062
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.64%	0.62%

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

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

3、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。

4、本基金的基金合同生效日为2022年4月19日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.09%	0.03%	0.09%	0.02%	0.00%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.64%	0.03%	0.56%	0.02%	0.08%	0.01%

注：1、本基金的业绩比较基准：中债综合财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%

中债综合财富（1-3 年）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中债综合指数细分指数之一。该指数同时覆盖了上海证券交易所、深圳证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的待偿期限在 1-3 年的债券，对中短期债券的价格变动趋势有很强的代表性。基于本基金主要投资中短期债券，选取该业绩比较基准能够忠实的反映本基金的风险收益特征。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 80%、20%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。

2、本基金的基金合同生效日为 2022 年 4 月 19 日。

浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C

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	0.09%	0.03%	0.09%	0.02%	0.00%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.62%	0.03%	0.56%	0.02%	0.06%	0.01%

注：1、本基金的业绩比较基准：中债综合财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%

中债综合财富（1-3 年）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中债综合指数细分指数之一。该指数同时覆盖了上海证券交易所、深圳证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的待偿期限在 1-3 年的债券，对中短期债券的价格变动趋势有很强的代表性。基于本基金主要投资中短期债券，选取该业绩比较基准能够忠实的反映本基金的风险收益特征。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 80%、20%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。

2、本基金的基金合同生效日为 2022 年 4 月 19 日。

### 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：本基金合同生效日为 2022 年 04 月 19 日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年04月19日-2022年06月30日)



注：本基金合同生效日为 2022 年 04 月 19 日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

## § 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2022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（LOF）、浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金、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、浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金、浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金、浙商汇金先进制造混合型证券投资基金、浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)、浙商汇金月享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浙商汇金兴利增强债券型证券投资基金、浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡玮菁	本基金基金经理，浙商汇金兴利增强债券型证券投资基金基金经理、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。	2022-04-19	-	18年	北京大学经济学硕士，18年金融行业从业经历。历任浦东发展银行股份有限公司资金总部交易员、太平养老保险股份有限公司投资管理中心投资经理、国投瑞银基金管理有限公司固定收益部副总监兼基金经理。2021年5月加入浙江浙商证券资产管理有限公司，现任公司公募固定收益投资部行政负责人。2021年10月起担任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，2022年3月起担任浙商汇金兴利增强债券型证券投资基金基金经理，2022

					年4月起担任浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理。
程嘉伟	本基金基金经理, 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、浙商汇金月享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理及浙商汇金短债债券型证券投资基金基金经理。	2022-04-19	-	10年	上海财经大学本科, 多年证券基金从业经历。历任上海国利货币经纪有限公司债券经纪人、中银基金固收交易员、国泰君安证券资产管理公司固定收益交易主管。2020年9月加入浙江浙商证券资产管理有限公司, 曾任基金经理助理, 现任公募固定收益投资部基金经理。2021年11月起任浙商汇金月享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理, 2022年3月起任浙商汇金短债债券型证券投资基金、浙商汇金聚泓两年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理, 2022年4月起担任浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理。

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、 市场回顾

上半年债券市场信用债表现好于利率债。利率债长端区间震荡，10年国债在2.70-2.85间反复，而信用债信用利差不断压缩，走出一波资产荒行情。

上半年债市利多主线是在货币政策保持宽松、财政支出加快、社融总量修复但结构较差和疫情反复。而利空主要来自俄乌冲突带动大宗商品高涨，引发通胀压力和通胀预期、股市疲软造成固收+产品赎回债券抛压、中美利差倒挂造成资本外流的担忧、经济数据边际修复造成市场对久期风险的担忧。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A基金份额净值为1.0064元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.64%，同期业绩比较基准收益率为0.56%；截至报告期末浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C基金份额净值为1.0062元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.62%，同期业绩比较基准收益率为0.56%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

### 三季度市场判断

1. 资金面，三季度流动性可能中性收敛，但DR007中枢可能仍然低于OMO利率。

前期资金面保持宽松的一个重要因素是财政支出较快，导致M2高企，社融-M2剪刀差收窄。6月随着专项债发行量激增，财政支出力度加大。往后看，随着地方债专项债发行使用完毕，下半年财政支出有放缓的可能，社融-M2剪刀差可能扩大，影响资金利率中枢。这一点需观察目前正积极推出的各类政策性金融工具、金融债券、专项债额度提前使用等多种工具落地情况从而去判断财政支出的力度，在不“出台超大规模刺激措施、超发货币、预支未来。”的背景下，下半年需要政策性金融接力，财政支出有放缓可能。

从历史看，经济复苏和通胀回升都将推动短端利率抬升。逻辑是融资需求的增加提供了更多信贷资产，降低了超储，推升了短端资金利率。这点还需观察社融结构修复的斜率和高度。

DR007中枢抬升空间有限，主要原因是上半年央行反复强调了用多种货币工具去降低企业融资成本，在总量货币工具受到中美利差和通胀掣肘下，央行未使用降准降息却达到了降准降息的效果。1年再贷款利率在1.75%，利率走廊实际下限要比OMO利率低，合意的DR007水平可能远在OMO利率之下。

2. 社融角度。社融总量修复靠政府债券，关注下半年国债发行进度和专项债额度提前使用情况。社融结构修复从历史看与地产和出口链条相关性较高。1) 地产方面，目前呈现出“环比显著增长、同比降幅收窄”的向好态势，6月30城商品房成交面积显著反弹，百强房企和百城成交量也都有明显起色。短期看，地产销售回暖可能来自于疫情后需求的集中释放和部分城市的政策大幅放松。中期看，目前地产政策放松力度较前几轮周期仍显不足，关注后续5年期LPR调降情况。而长期看，地产销售可能还是受制于居民收入、杠杆水平、人口拐点、人均居住面积等因素。总的来说，地产销售短期修复斜率较高，但修复高度还需持续关注，在6月的高增之后，7月初30大中城市商品房销售面积也出现了超季节性的回落。居民中长贷边际修复但持续性需观察。2) 出口方面，需求端由于美欧加息缩表导致经济预期衰退，发达经济体消费需求走弱，PMI新出口订单连续两月修复弱于整体也反应了这一点。需求减弱导致下半年出口虽有韧性，但有下行压力。

总得来说社融目前的总量和结构的修复或与政府债券供给、财政乘数效应、疫情期间地产需求释放有关，持续性还需要结合后续的经济数据和高频数据再进行谨慎判断。在地产销售边际转好但仍处于底部，出口下半年因需求减弱有下行压力，下半年社融总量修复仍要关注政府债券。结构修复需密切关注目前正积极推出的各类政策性金融工具、金融债券、专项债额度提前使用等多种工具落地情况从而去判断财政支出的力度，同时也要关注地产销售回暖的持续性。

3. 货币政策角度

短期看社融结构边际修复，修复斜率可能较高，但修复高度存疑。央行仍需维持稳健偏松的货币环境以推进宽信用进程。第二季度货币政策委员会例会增加了“保持物价水平基本稳定”的措辞，反映出政策当局对物价上涨的关注度提升，6月CPI同比升至2.5%，但核心CPI同比仍然只有1%仍处于低位，央行因通胀调整货币政策方向的概率不大。同时中美利差仍有倒挂风险。央行使用总量货币工具的概率还是较低，三季度大概率仍通过多种货币工具维持稳健偏宽松的货币环境。

#### 策略方面

在稳经济政策的发力下，疫情后经济数据可能边际持续改善，债市短期受此承压，但社融总量和结构修复未必是债市拐点的信号，市场将博弈修复的持续性和高度。地产方面7月数据弱于季节性，反应6月销售较好可能是与疫情间需求集中释放有关，同时二三线城市商品房销售明显弱于往年同期水平，或表明目前全国层面购房需求仍处于较低水平。居民中长贷的修复持续性存疑。而企业端融资需求可能与专项债资金落地撬动配套资金有关，这也是票据贴现市场较弱的原因，这点需观察后续财政落政策和政策性金融工具落地情况。尤其在“不会为了过高增长目标而出台超大规模刺激措施、超发货币、预支未来后”的背景下，下半年需关注政策性金融工具的落地情况。但无论是专项债还是政金债，其实都是以财政乘数推动的宽信用进程，可能导致社融-m2仍处于低位，长端有继续下行的空间。

#### 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。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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。

#### 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，本基金未发生《公开募集证券投资基金运行管理办法》的第四十一条所述情形。

### § 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	6,213,500.95
结算备付金		-



存出保证金		13,519.99
交易性金融资产	6.4.7.2	281,530,912.62
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		281,530,912.62
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	29,004,761.40
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		1,860,291.95
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		318,622,986.91
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	本期末 2022年06月30日
<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		6,000,361.64
应付清算款		-
应付赎回款		-

应付管理人报酬		73,329.49
应付托管费		18,332.32
应付销售服务费		29,878.19
应付投资顾问费		-
应交税费		75,306.91
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	68,655.26
负债合计		6,265,863.81
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	310,412,738.28
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	1,944,384.82
净资产合计		312,357,123.10
负债和净资产总计		318,622,986.91

注：报告截止日2022年06月30日，浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A基金份额净值1.0064元，基金份额总额62,960,170.25份。浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C基金份额净值1.0062元，基金份额总额247,452,568.03份。本基金基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度末数据。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金

本报告期：2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年04月19日（基金合同 生效日）至2022年06月30 日
一、营业总收入		3,617,219.47
1. 利息收入		220,741.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	111,189.38
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		109,551.86
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,494,581.78
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	3,494,581.78
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-98,103.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
<b>减：二、营业总支出</b>		576,765.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	188,860.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	47,215.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	77,227.59
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		208,145.35
其中：卖出回购金融资产支出		208,145.35
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		10,564.05
8. 其他费用	6.4.7.19	44,752.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,040,454.27

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,040,454.27
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,040,454.27

注：本基金基金合同生效日为2022年04月19日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金

本报告期：2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	501,081,653. 25	-	-	501,081,653. 25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	501,081,653. 25	-	-	501,081,653. 25
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	-190,668,91 4.97	-	1,944,384.82	-188,724,53 0.15
（一）、综合收益总 额	-	-	3,040,454.27	3,040,454.27
（二）、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）	-190,668,91 4.97	-	-1,096,069.4 5	-191,764,98 4.42

其中：1. 基金申购款	22,307,305.16	-	124,481.91	22,431,787.07
2. 基金赎回款	-212,976,220.13	-	-1,220,551.36	-214,196,771.49
(三)、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）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	310,412,738.28	-	1,944,384.82	312,357,123.10

注：本基金基金合同生效日为2022年04月19日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

高存

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

浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)(证监许可[2021]3753号)《关于准予浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金注册的批复》批准,由浙江浙商证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》向社会公开发行募集。《浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》于2022年04月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为501,081,653.25份基金份额,其中浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A基金份额总额90,351,008.90份,浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C基金份额总额410,730,644.35份,相关募集业经北京兴华会计师事务所[2022]京会兴验字第68000003号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式基金,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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

#### 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《浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券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2022年06月30日的财务状况以及2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日的经营成果和基金资产净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制，即自每年01月01日至12月31日为一个会计年度。本报告会计期间为2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下三类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融负债在初始确认时划分为以下三类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；（2）金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；（3）以摊余成本计量的金融负债。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

### (1) 金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

基金或公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。但是，初始确认的应收账款未包含重大融资成分或不考虑未超过一年的合同中的融资成分的，按照《企业会计准则第14号——收入》所定义的交易价格进行初始计量。

### (2) 金融资产的后续计量方法

#### 1) 以摊余成本计量的金融资产

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

#### 2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

采用公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

#### 3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

采用公允价值进行后续计量。获得的股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

#### 4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

采用公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

### (3) 金融负债的后续计量方法

#### 1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。对于此类金融负债以公允价值进行后续计量。因基金或公司自身信用风险变动引起的指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的公允价值变动金额计入其他综合收益，除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配。此类金融负债产生的其他利得或损失（包括利息费用、除因自身信用风险变动引起的公允价值变动）计入当期损益，除非该金融负债属于套期关系的一部分。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债按照《企业会计准则第23号——金融资产转移》相关规定进行计量。

3) 不属于上述1)或2)的财务担保合同，以及不属于上述1)并以低于市场利率贷款的贷款承诺

在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：①按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；②初始确认金额扣除按照《企业会计准则第14号——收入》相关规定所确定的累计摊销额后的余额。

#### 4) 以摊余成本计量的金融负债

采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融负债所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销时计入当期损益。

#### (4) 金融资产和金融负债的终止确认

##### 1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

② 金融资产已转移，且该转移满足《企业会计准则第23号——金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

2) 当金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除时，相应终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。本基金将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据作出的财务预测等。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不相互抵销。但同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：(1)具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；(2)计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。



不满足终止确认条件的金融资产转移，本基金不对已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于申购确认日或赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1. 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
2. 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；
3. 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在证券回购期内逐日计提；
4. 股票、基金投资收益于卖出股票、基金成交日确认，并按卖出股票、基金成交金额与其成本的差额入账，同时调整公允价值变动损益；
5. 债券投资收益于成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额入账，同时调整公允价值变动损益；
6. 衍生工具投资收益于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账，同时调整公允价值变动损益；
7. 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
8. 公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
9. 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人与基金管理人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起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。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人与基金管理人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起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。

### 3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，并由基金管理人代为支付给C类基金份额销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 3. 按照国家有关规定可以列入的其他费用

本基金存续期间发生的信息披露费，与基金资产相关的会计师审计费和律师费、基金资产终止时的清算费用以及按照管理合同及国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据其他相关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金资产费用。

### 4. 基金税收

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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；

2、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；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的基金份额净值折算成基金份额，红利再投资的份额免收申购费；

3、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基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 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 and 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 2022年06月30日
----	--------------------

活期存款	6,213,500.95
等于：本金	6,213,308.77
加：应计利息	192.18
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,213,500.95

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	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	-	-	-
	银行间市场	277,981,113.55	3,647,902.62	281,530,912.62
	合计	277,981,113.55	3,647,902.62	281,530,912.62
				-98,103.55

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	277,981,113.55	3,647,902.62	281,530,912.62	-98,103.55

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2022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	29,004,761.40	-
合计	29,004,761.40	-

#### 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 其他资产

本基金于本报告期末，未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-

应付交易费用	28,178.22
其中：交易所市场	-
银行间市场	28,178.22
应付利息	-
预提费用	40,477.04
合计	68,655.26

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A

金额单位：人民币元

项目 (浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A)	本期 2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	90,351,008.90	90,351,008.90
本期申购	5,543,940.88	5,543,940.88
本期赎回（以“-”号填列）	-32,934,779.53	-32,934,779.53
本期末	62,960,170.25	62,960,170.25

##### 6.4.7.7.2 浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C

金额单位：人民币元

项目 (浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C)	本期 2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	410,730,644.35	410,730,644.35
本期申购	16,763,364.28	16,763,364.28
本期赎回（以“-”号填列）	-180,041,440.60	-180,041,440.60
本期末	247,452,568.03	247,452,568.03

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

2、本基金合同于2022年04月19日生效。基金合同生效日浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A基金份额总额为90,351,008.90份基金份额，其中认购资金利息折合3,379.75份

基金份额：浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C基金份额总额为410,730,644.35份基金份额，其中认购资金利息折合10,649.72份基金份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A

单位：人民币元

项目 (浙商汇金双月鑫60天 滚动持有中短债A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	585,581.23	-19,024.17	566,557.06
本期基金份额交易产生的变动数	-163,230.29	313.54	-162,916.75
其中：基金申购款	33,508.18	-2,109.71	31,398.47
基金赎回款	-196,738.47	2,423.25	-194,315.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	422,350.94	-18,710.63	403,640.31

##### 6.4.7.8.2 浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C

单位：人民币元

项目 (浙商汇金双月鑫60天 滚动持有中短债C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,552,976.59	-79,079.38	2,473,897.21
本期基金份额交易产生的变动数	-938,714.44	5,561.74	-933,152.70
其中：基金申购款	100,758.67	-7,675.23	93,083.44
基金赎回款	-1,039,473.11	13,236.97	-1,026,236.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,614,262.15	-73,517.64	1,540,744.51

注：本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。



#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日
活期存款利息收入	108,645.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,509.89
其他	34.43
合计	111,189.38

注:1、其他为结算保证金应收利息。

2、本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期末进行股票投资。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金在本报告期末进行基金投资。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	3,214,568.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	280,013.56
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	3,494,581.78
----	--------------

注：本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	914,492,913.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	909,867,445.47
减：应计利息总额	4,328,743.53
减：交易费用	16,710.93
买卖债券差价收入	280,013.56

注：本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.13 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。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未进行贵金属投资。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 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。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

##### 6.4.7.15.2 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。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-98,103.55
——股票投资	-
——债券投资	-98,103.55
——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	-98,103.55

注：本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日

审计费用	12,072.01
信息披露费	28,405.03
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,875.04
其他	400.00
合计	44,752.08

注：本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，合同生效当期不是完整报告期。

#### 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
兴业银行股份有限公司	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

本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期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 2022 年 04 月 19 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
浙商证券股份有限 公司	207,874,049.20	100.00%

注：本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度可比期间数据。

#### 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 2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
浙商证券股份有限 公司	208,200,000.00	100.00%

注：本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末无应付关联方佣金余额。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度可比期间数据及上年度末数据。

#### 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 2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06 月30日

当期发生的基金应支付的管理费	188,860.95
其中：支付销售机构的客户维护费	95,783.49

注：本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度可比期间数据。

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人与基金管理人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起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
	2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	47,215.18

注：本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度可比期间数据。

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人与基金管理人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C	合计

浙商证券	0.00	78,119.64	78,119.64
兴业银行	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	78,119.64	78,119.64

注：本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度可比期间数据。

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，并由基金管理人代为支付给C类基金份额销售机构。若遇法定节假日、公休假等，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

本基金本报告期末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2022年04月19日，无上年度可比期间数据。

#### 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，未发生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。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度可比期间数据。

##### 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，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2022年04月19日，无上年度可比期间数据。

#### 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**

本报告期内基金管理人未持有本基金。本基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度同期对比数据。

**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**

在本报告期末未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。本基金的基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度末数据。

**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 2022年04月19日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	6,213,500.95	108,645.06

注：（1）本基金的银行存款由基金托管人兴业银行进行保管，按银行同业利率计息。  
（2）本基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况，本基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度同期对比数据。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金在本报告期内未发生其他关联交易事项，基金合同生效日为2022年04月19日，无上年度同期对比数据。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型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，本基金本报告期未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2022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2022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6,000,361.64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
102001079	20镇江城建MTN003	2022-07-01	101.15	100,000	10,115,383.56
合计				100,000	10,115,383.56

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022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

本基金本报告期末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风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险、利率风险和其他价格风险。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兴业银行，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	65,507,810.97
合计	65,507,810.97

注：本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。本表主要列示短期融资券和超短期融资券，评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示短期融资券和超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有同业存单。本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。

##### 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 2022年06月30日
AAA	10,114,640.00
AAA以下	171,631,551.96
未评级	34,276,909.69
合计	216,023,101.65

注：本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有同业存单。本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。

#### 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 2022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	6,213,500.95	-	-	-	-	6,213,500.95

存出保证金	13,519.99	-	-	-	-	13,519.99
交易性金融资产	34,276,909.69	6,295,270.03	148,046,559.19	92,912,173.71	-	281,530,912.62
买入返售金融资产	29,004,761.40	-	-	-	-	29,004,761.40
资产总计	69,508,692.03	6,295,270.03	148,046,559.19	92,912,173.71	0.00	316,762,694.96
负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	6,000,361.64	-	-	-	-	6,000,361.64
负债总计	6,000,361.64	-	-	-	-	6,000,361.64
流动性净额	63,508,330.39	6,295,270.03	148,046,559.19	92,912,173.71	0.00	310,762,333.32

注：本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。

#### 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 2022 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	不计息	合计
资产							
银行存款	6,213,500.95	-	-	-	-	-	6,213,500.95
存出保证金	13,519.99	-	-	-	-	-	13,519.99
交易性金融资产	34,276,909.69	6,295,270.03	148,046,559.19	92,912,173.71	-	-	281,530,912.62
买入返售金融资产	29,004,761.40	-	-	-	-	-	29,004,761.40
应收申购款	-	-	-	-	-	1,860,291.95	1,860,291.95
资产总计	69,508,692.03	6,295,270.03	148,046,559.19	92,912,173.71	-	1,860,291.95	318,622,986.91
负债							
卖出回购金融资产款	6,000,361.64	-	-	-	-	-	6,000,361.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	73,329.49	73,329.49
应付托管费	-	-	-	-	-	18,332.32	18,332.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	29,878.19	29,878.19
应交税费	-	-	-	-	-	75,306.91	75,306.91
其他负债	-	-	-	-	-	68,655.26	68,655.26
负债总计	6,000,361.64	-	-	-	-	265,502.17	6,265,863.81
利率敏感度缺口	63,508,330.39	6,295,270.03	148,046,559.19	92,912,173.71	-	1,594,789.78	312,357,123.10

注：本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。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（单位：人民币元）
		本期末 2022年06月30日
	1、利率下降25个基点	669,766.26
	2、利率上升25个基点	-665,675.62

注：本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。

#### 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 2022年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)

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	281,530,912.62	90.13
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	281,530,912.62	90.13

注：本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。

#### 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。本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。

#### 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 2022年06月30日
	风险价值	-83,459.07

注：本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日
第一层次	-
第二层次	281,530,912.62
第三层次	-
合计	281,530,912.62

注：本基金合同生效日为2022年4月19日，无上年度末数据。

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项



截至资产负债表日，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	281,530,912.62	88.36
	其中：债券	281,530,912.62	88.36
	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	29,004,761.40	9.10
	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	6,213,500.95	1.95
8	其他各项资产	1,873,811.94	0.59
9	合计	318,622,986.91	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末基金资产净值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末基金资产净值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	34,276,909.69	10.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	26,257,745.10	8.41
5	企业短期融资券	65,507,810.97	20.97
6	中期票据	155,488,446.86	49.78
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	281,530,912.62	90.13

#### 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	229915	22贴现国债15	343,000	34,276,909.69	10.97
2	102100028	21赣州开投MT	300,000	31,328,465.7	10.03

		N001		5	
3	102101825	21新海连MTN0 02	200,000	21,611,506.8 5	6.92
4	012281600	22盐城国投SC P002	200,000	20,171,605.4 8	6.46
5	102281129	22无锡文旅MT N001	200,000	19,978,928.2 2	6.40

#### 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 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 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	13,519.99
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,860,291.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,873,811.94

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
浙商	332	189,639.07	0.00	0.00%	62,960,170.25	100.0

汇金双月鑫60天滚动持有中短债A						0%
浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C	1,270	194,844.54	0.00	0.00%	247,452,568.03	100.00%
合计	1,602	193,765.75	0.00	0.00%	310,412,738.30	100.00%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A	25,950.00	0.0412%
	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C	560,001.94	0.2263%
	合计	585,951.94	0.1888%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A	0
	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A	0
	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C	0
	合计	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

	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债A	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债C
基金合同生效日(2022年04月19日)基金份额总额	90,351,008.90	410,730,644.35
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,543,940.88	16,763,364.28
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	32,934,779.53	180,041,440.60
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	62,960,170.25	247,452,568.03

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。

## § 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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 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	
浙商证券	2	-	-	-	-	-

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，本基金租用了浙

商证券27353和393754的沪深交易单元一对。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

### 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
浙商证券	207,874,049.20	100.00%	208,200,000.00	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	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2022-03-28
2	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2022-03-28
3	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2022-03-28
4	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基	中国证监会规定媒介	2022-03-28



	金托管协议		
5	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金2022年资料概要	中国证监会规定媒介	2022-03-28
6	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2022-04-20
7	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与平安证券股份有限公司费率优惠活动和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-27
8	浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-09
9	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与众惠基金销售有限公司开通定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-10
10	浙江浙商证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京肯特瑞基金销售有限公司申购起点金额及最低持有数量限制的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-21
11	浙江浙商证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司申购起点金额及最低持有数量限制的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-21

## § 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

2022年8月，浙江浙商证券资产管理有限公司的合规总监和首席风险官由方斌先生变更为杨锴先生，上述人事变动已按照相关法律法规的规定进行备案和公告。

## § 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双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金的文件；

《浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》；

《浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券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

二〇二二年八月三十日