

浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金

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:光大证券股份有限公司

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。

基金托管人光大证券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01月01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	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	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57

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.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
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.....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金	
基金简称	浙商汇金量化臻选股票	
基金主代码	011824	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年07月01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	光大证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	168,368,102.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浙商汇金量化臻选股 票A	浙商汇金量化臻选股 票C
下属分级基金的交易代码	011824	011825
报告期末下属分级基金的份额总额	116,902,836.11份	51,465,266.52份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用数量化方法进行资产配置和个股精选，力争在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用以股票投资为主，固定收益类资产管理为辅的投资策略。本基金一方面通过量化资产配置策略，进行股票、债券等各类资产组合间的比例调整，另一方面通过量化选股模型选择优势股票组合，以期实现高于业绩基准的投资收益。</p> <p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>本基金以多因子选股策略为主体、事件驱动策略为补充，精选个股进行组合配置，从而追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。具体如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、多因子选股策略 2、事件驱动选股策略

	<p>3、港股通标的股票投资策略</p> <p>(三) 债券等固定收益类资产投资策略 本基金固定收益类资产的投资目标主要为非股票资产的有效使用和管理。</p> <p>(四) 金融衍生工具投资策略 本基金基于审慎原则运用股指期货、国债期货、股票期权等相关金融衍生工具，将严格根据风险管理的原则，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，从而达到降低投资组合风险、提高投资效率，更好地实现本基金投资目标。</p> <p>(五) 资产支持证券投资策略 对于资产支持证券，本基金将在国内资产证券化品种具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后做出相应的投资决策。</p> <p>(六) 可转换债券和可交换债券投资策略 本基金密切跟踪经济运行情况，对各类市场大势做出判断的前提下，对可转换债券及其正股、可交换债券和对应股票进行综合分析。</p>
业绩比较基准	<p>中证500指数收益率×50%+中证港股通综合指数收益率×40%+中债总财富指数（总值）收益率×10%</p>
风险收益特征	<p>本基金属于“中高风险”品种，为股票型基金，一般市场情况下，长期风险收益特征高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金。本基金将投资港股通标的股票，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金将承担港股通机制下汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。</p>

注：本基金采用证券公司交易结算模式。基金管理人负责选择证券经纪商，由基金管理人与基金托管人及证券经纪商签订本基金的证券经纪服务协议，明确三方在本基金参与场内证券买卖中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。

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	光大证券股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	楼小平	李庆庆
	联系电话	0571-87903297	021-22167432
	电子邮箱	fund@stocke.com.cn	gztg@ebscn.com
客户服务电话	95345	95525	
传真	0571-87902581	021-22167424	
注册地址	浙江省杭州市拱墅区天水巷2 5号	上海市新闻路1508号	
办公地址	浙江省杭州市上城区五星路2 01号浙商证券大楼7楼	上海市新闻路1508号	
邮政编码	310020	200040	
法定代表人	盛建龙	刘秋明	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.stocke.com.cn
基金中期报告备置地点	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01月01日-2022年06月30日)	
	浙商汇金量化臻选 股票A	浙商汇金量化臻选 股票C
本期已实现收益	-16,648,829.83	-7,370,774.51
本期利润	-7,491,302.10	-3,273,114.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0610	-0.0611
本期加权平均净值利润率	-6.85%	-6.90%
本期基金份额净值增长率	-5.38%	-5.62%
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	-16,419,566.75	-7,441,808.57
期末可供分配基金份额利润	-0.1405	-0.1446
期末基金资产净值	108,539,574.58	47,544,254.01
期末基金份额净值	0.9285	0.9238
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	-7.15%	-7.62%

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。

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

浙商汇金量化臻选股票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	8.88%	1.03%	4.53%	1.02%	4.35%	0.01%
过去三个月	5.30%	1.50%	1.39%	1.38%	3.91%	0.12%
过去六个月	-5.38%	1.44%	-9.40%	1.48%	4.02%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-7.15%	1.14%	-12.34%	1.20%	5.19%	-0.06%

注：1、本基金业绩比较基准： $\text{中证 500 指数收益率} \times 50\% + \text{中证港股通综合指数收益率} \times 40\% + \text{中债总财富指数（总值）收益率} \times 10\%$

中证 500 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证港股通综合指数由中证指数有限公司编制，反映了港股通范围内上市公司的整体状况和走势，具有良好的市场代表性，适合作为本基金港股投资部分的业绩基准。中债总财富指数（总值）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖上海证券交易所、深圳证券交易所以及银行间市场的各类券种，综合反映了债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。该指数合理、透明、公开，具有较好的市场接受度，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够反映本基金的风险收益特征。本基金业绩基准指数每日按照 50%、40%、10% 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 2021 年 07 月 01 日。

浙商汇金量化臻选股票 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	8.84%	1.03%	4.53%	1.02%	4.31%	0.01%
过去三个月	5.16%	1.49%	1.39%	1.38%	3.77%	0.11%
过去六个月	-5.62%	1.44%	-9.40%	1.48%	3.78%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-7.62%	1.14%	-12.34%	1.20%	4.72%	-0.06%

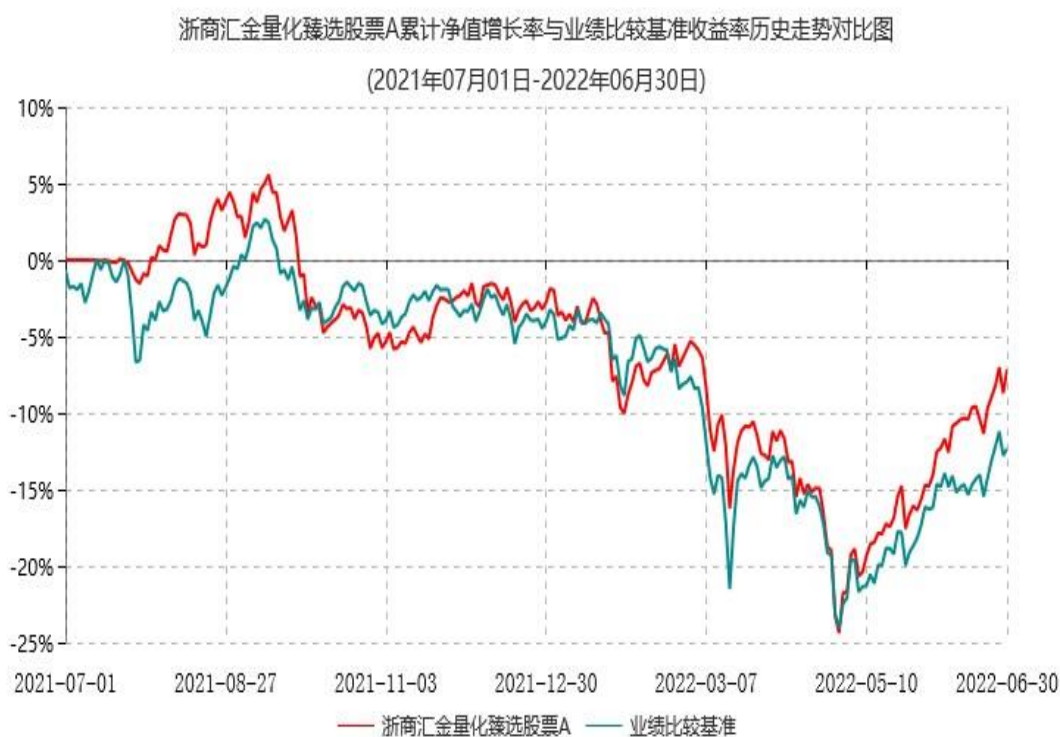
注：1、本基金业绩比较基准： $\text{中证 500 指数收益率} \times 50\% + \text{中证港股通综合指数收益率} \times 40\% + \text{中债总财富指数（总值）收益率} \times 10\%$

中证 500 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证港股通综合指数由中证指数有限公司编制，反映了港股通范围内上市公司的整体状况和走势，具有良好的市场代表性，适合作为本基金港股投资部分的业绩基准。中债总

财富指数（总值）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖上海证券交易所、深圳证券交易所以及银行间市场的各类券种，综合反映了债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。该指数合理、透明、公开，具有较好的市场接受度，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够反映本基金的风险收益特征。本基金业绩基准指数每日按照 50%、40%、10% 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 2021 年 07 月 01 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 2021 年 7 月 1 日，至本报告期末，本基金已完成建仓。建仓期为 2021 年 7 月 1 日-2021 年 12 月 31 日，但报告期末距建仓结束不满一年，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

浙商汇金量化臻选股票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
(2021年07月01日-2022年06月30日)



注：本基金合同生效日为2021年7月1日，至本报告期末，本基金已完成建仓。建仓期为2021年7月1日-2021年12月31日，但报告期末距建仓结束不满一年，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浙江浙商证券资产管理有限公司成立于2013年4月18日，是原浙商证券有限责任公司设立的全资子公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准浙商证券有限责任公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可（2012）1431号）批准，由浙商证券股份有限公司出资12亿元从事资产管理业务。2014年8月19日中国证券监督管理委员会批准《关于核准浙江浙商证券资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可（2014）857号）。公司主要经营范围涉及证券资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务。截止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		
周涛	总经理助理；本基金基金经理；浙商汇金转型驱动灵活配置混合型基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型基金及浙商汇金新兴消费灵活配置混合型基金的基金经理	2021-07-01	-	16年	中国国籍，硕士，曾任国金证券研究所首席行业分析师、齐鲁证券研究所所长、浙商证券证券投资部总经理、浙商资本副总经理。2017年加入浙江浙商证券资产管理有限公司，曾任浙商汇金转型成长混合型基金及浙商汇金中证转型成长指数基金的基金经理；现任总经理助理、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型基金、浙商汇金新兴消费灵活配置混合型基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型基金、浙商汇金量化臻选股票型证

					券投资基金的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
叶方强	本基金基金经理助理；浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金联接基金的基金经理助理	2022-02-23	-	6年	中国国籍，硕士，曾任浙商证券股份有限公司证券投资交易员，现任浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金联接基金及浙商汇金量化臻选股票型基金的基金经理助理。

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，确保基金资产的安全并以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

2022年上半年，A股市场在美债收益率快速上升、俄乌地缘冲突以及国内疫情反复影响下，出现了三次显著下跌，在疫情最终可控之后才迎来明显反弹。

总体来看，剔除外围的变量干扰后，直接影响国内A股市场巨幅波动的核心变量当属疫情的演绎，以及稳增长相关的政策驱动。如果做一个简单的总结，市场演绎的主线逻辑有三点，第一条主线是通胀相关的链条，包括了煤炭、原油、钾肥、磷矿等等；第二条主线是以成长相关的行业板块，特别是新能源，如新能源车、光伏、风电；第三条主线是基于疫情修复板块，这个板块的面涉及非常广，既有传统的与消费相关的部分，也有与新能源相关的车以及零部件等，当然汽车零部件更多是指电动化与智能化相关的部分。总体来看，通胀链公司成为上半年最突出的表现板块，同时成长相关的反弹成为二季度最强的主线。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商汇金量化臻选股票A基金份额净值为0.9285元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.38%，同期业绩比较基准收益率为-9.40%；截至报告期末浙商汇金量化臻选股票C基金份额净值为0.9238元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.62%，同期业绩比较基准收益率为-9.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，影响国内国际的因素主要有如下几点：1、美国超预期的加息带来的国际金融市场剧烈波动，美国已经开始从“滞胀交易”部分过渡到“衰退交易”，譬如大宗之母原油价格的大幅回调与波动，并带动大部分的大宗商品的下跌，包含了有色金属、黑色金属、化工产品、以及部分农产品等。我们预计下半年大宗商品将步入偏弱的区间震荡运行。2、国内经济5月份以来，在各类综合政策的加持下出现了明显的回暖走势，不过从工业运行的主要指标观察，经济预计处于弱反弹的概率更高一些。我们预计下半年国内经济将寻求“弱复苏”的正式底部，完成新一轮经济复苏的起点构造。3、在美国衰退预期越来越强的背景下，预计国内下半年的复苏之路也会比较反复，下半年稳增长及货币政策快速收缩的概率不高。

而市场将在以上国内国际经济形势较量下继续呈现结构性机会。

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

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明本报告期内光大证券股份有限公司（以下简称“本托管人”）在浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）的托管过程中严格遵守《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

本报告期内本托管人根据《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对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金

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	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,860,464.09	18,927,618.75
结算备付金		1,334,519.80	9,480,601.22
存出保证金		-	1,431,936.80
交易性金融资产	6.4.7.2	140,420,054.75	158,271,421.83
其中：股票投资		140,420,054.75	158,271,421.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		13,039.96	106,420.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	3,650.50
资产总计		156,628,078.60	188,221,649.34
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		134,581.01	360,977.96
应付管理人报酬		185,379.95	239,855.82
应付托管费		24,717.33	31,980.78
应付销售服务费		18,844.63	23,825.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	29,775.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	180,727.09	143,576.23
负债合计		544,250.01	829,991.97
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	168,368,102.63	191,111,307.68
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-12,284,274.04	-3,719,650.31

净资产合计		156,083,828.59	187,391,657.37
负债和净资产总计		156,628,078.60	188,221,649.34

注：1、本基金基金合同生效日为2021年07月01日，报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2、报告截止日2022年6月30日，基金份额净值0.9270元，基金份额总额168,368,102.63份。

6.2 利润表

会计主体：浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2022年0 6月30日
一、营业总收入		-9,239,249.78
1. 利息收入		51,471.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	51,471.57
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-22,635,218.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,309,234.15
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	-
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	314,531.18
股利收益	6.4.7.16	1,359,484.25
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	13,255,187.29
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	89,310.08
减：二、营业总支出		1,525,167.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,168,567.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	155,809.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	117,782.16
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		2,425.27
8. 其他费用	6.4.7.19	80,583.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,764,417.05
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,764,417.05
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-10,764,417.05

注：本基金基金合同生效日为2021年07月01日，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：浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01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)	191,111,307. 68	-	-3,719,650.3 1	187,391,657. 37
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)	191,111,307. 68	-	-3,719,650.3 1	187,391,657. 37
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-22,743,205. 05	-	-8,564,623.7 3	-31,307,828. 78
(一)、综合收益总 额	-	-	-10,764,417. 05	-10,764,417. 05
(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)	-22,743,205. 05	-	2,199,793.32	-20,543,411. 73
其中: 1. 基金申购款	1,744,009.55	-	-184,760.37	1,559,249.18
2. 基金赎回 款	-24,487,214. 60	-	2,384,553.69	-22,102,660. 91
(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)	168,368,102. 63	-	-12,284,274. 04	156,083,828. 59

本基金基金合同生效日为2021年07月01日,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

浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2021] 641号《关于准予浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金注册的批复》确认,由浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“浙商资产管理公司”)作为管理人,光大证券股份有限公司(以下简称“光大证券”)作为托管人,于2021年07月01日募集设立。浙商资产管理公司是本基金的发售机构。本基金的募集期间为2021年06月07日至2021年06月28日止,本基金类型为股票型证券投资基金,基金的运作方式为契约型开放式,存续期为不定期。

根据《浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金招募说明书》约定,本基金的推广对象为:符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。每份基金资产面值为人民币1.00元。截至2021年06月30日,该基金首次向社会公开发售募集(扣除认购手续费后)的实收基金(本金)人民币贰亿捌仟伍佰叁拾玖万捌仟贰佰伍拾陆元贰角肆分(285,398,256.24元)。该基金首次发行募集的实收基金(本金)折合份额为285,398,256.24份,募集期间产生的利息折合份额为18,521.29份,共计贰亿捌仟伍佰肆拾壹万陆仟柒佰柒拾柒元伍角叁分份(285,416,777.53份),其中A类基金份额认购总额为人民币180,028,974.03元,净认购金额为人民币178,494,211.52元,折合份额为178,494,211.52份,利息转份额为9,509.25份,共计178,503,720.77份;C类基金份额认购总额为人民币106,904,044.72元,即其净认购金额,折合份额为106,904,044.72份,利息转份额为9,012.04份,共计106,913,056.76份。设立募集资金已经北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)杭州分公司验资,并出具[2021]京会兴浙分验字第68000030号验资报告。

截至2022年6月30日,本基金有效份额总额为168,368,102.63份,其中A类有效份额为116,902,836.11份;C类有效份额为51,465,266.52份。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、

国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例为基金资产的80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金业绩比较基准：中证500指数收益率×50%+中证港股通综合指数收益率×40%+中债总财富指数（总值）收益率×10%

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“企业会计准则”）编制，同时参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况以及2022年01月01日至2022年6月30日的经营成果和净值变动情况等有关信息。

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

除6.4.5.1列示的会计政策变更内容外，本基金在本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

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

（一）增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140号文《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局财税〔2017〕2号文《财政部国家税务总局关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财政部、国家税务总局财税〔2017〕56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的有关规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；本基金的基金管理人运营本基金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，通知自2018年1月1日起施行。对本基金在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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(二) 城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加

本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

(三) 印花税

本基金管理人运用基金买卖股票，卖出股票按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。

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	230,259.78
等于：本金	230,091.70
加：应计利息	168.08
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	14,630,204.31
等于：本金	14,628,001.83
加：应计利息	2,202.48
减：坏账准备	-
合计	14,860,464.09

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	129,113,701.36	-	140,420,054.75	11,306,353.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	129,113,701.36	-	140,420,054.75	11,306,353.39

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

本基金于本报告期末，未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 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	144.08
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	180,583.01
合计	180,727.09

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 浙商汇金量化臻选股票A

金额单位：人民币元

项目 (浙商汇金量化臻选股票A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	134,288,846.23	134,288,846.23
本期申购	566,310.91	566,310.91
本期赎回(以“-”号填列)	-17,952,321.03	-17,952,321.03
本期末	116,902,836.11	116,902,836.11

6.4.7.7.2 浙商汇金量化臻选股票C

金额单位：人民币元

项目 (浙商汇金量化臻选股票C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	56,822,461.45	56,822,461.45

本期申购	1,177,698.64	1,177,698.64
本期赎回（以“-”号填列）	-6,534,893.57	-6,534,893.57
本期末	51,465,266.52	51,465,266.52

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 浙商汇金量化臻选股票A

单位：人民币元

项目 (浙商汇金量化臻选股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-495,188.98	-2,019,376.20	-2,514,565.18
本期利润	-16,648,829.83	9,157,527.73	-7,491,302.10
本期基金份额交易产生的变动数	724,452.06	918,153.69	1,642,605.75
其中：基金申购款	-25,261.20	-44,172.86	-69,434.06
基金赎回款	749,713.26	962,326.55	1,712,039.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,419,566.75	8,056,305.22	-8,363,261.53

6.4.7.8.2 浙商汇金量化臻选股票C

单位：人民币元

项目 (浙商汇金量化臻选股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-350,389.52	-854,695.61	-1,205,085.13
本期利润	-7,370,774.51	4,097,659.56	-3,273,114.95
本期基金份额交易产生的变动数	279,355.46	277,832.11	557,187.57
其中：基金申购款	-52,100.52	-63,225.79	-115,326.31
基金赎回款	331,455.98	341,057.90	672,513.88
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-7,441,808.57	3,520,796.06	-3,921,012.51
-----	---------------	--------------	---------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	24,350.00
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	27,121.57
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	51,471.57

注：其他为结算保证金应收利息。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	370,116,913.94
减：卖出股票成本总额	393,453,920.31
减：交易费用	972,227.78
买卖股票差价收入	-24,309,234.15

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。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金在本报告期末进行债券投资。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末进行资产支持证券投资

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未进行贵金属投资。

6.4.7.15 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。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022年01月01日至2022年06月30日
期货投资	314,531.18

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,359,484.25
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,359,484.25

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01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	14,138,171.82
——股票投资	14,138,171.82
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-912,760.00

——权证投资	-
——期货投资	-912,760.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-29,775.47
合计	13,255,187.29

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	23,461.23
其他	65,848.85
合计	89,310.08

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022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	-
合计	80,583.01

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
光大证券股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构
浙江浙商证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商证券股份有限公司	基金管理人的母公司、本基金销售机构
浙商期货有限公司	受基金管理人母公司控制的公司

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
光大证券股份有限 公司	729,748,035.99	100.00%

注：本基金的基金合同生效日为2021年07月01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2021年07月01日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金的基金合同生效日为2021年07月01日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金的基金合同生效日为2021年07月01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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
光大证券股份有限公司	536,583.24	100.00%	-	-

注：1、本基金为券商结算模式，上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、本基金的基金合同生效日为2021年07月01日，无上年度可比期间数据。

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01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,168,567.83
其中：支付销售机构的客户维护费	575,299.11

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前5个工作

日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2、本基金的基金合同生效日为2021年07月01日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	155,809.00

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

2、本基金的基金合同生效日为2021年07月01日，无上年度可比期间数据。

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01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浙商汇金量化臻选股票A	浙商汇金量化臻选股票C	合计
浙商证券	0.00	59,058.33	59,058.33
光大证券	0.00	16,363.89	16,363.89
合计	0.00	75,422.22	75,422.22

注：1、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0.50%，按前一日C类基金资产净值的0.50%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为前一日C类基金份额基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性按照指定账户路径进行资金支付，并由基金管理人按相关合同规定代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

2、本基金的基金合同生效日为2021年07月01日，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期内，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。本基金的基金合同生效日为2021年07月01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2021年07月01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2021年07月01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。本基金的基金合同生效日为2021年07月01日，无上年度可比期间数据。

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 2022年01月01日至2022年06月30日

	期末余额	当期利息收入
光大证券股份有限公司	230,259.78	24,350.00

注：本基金的银行存款存放在托管人光大证券在交通银行开立的托管账户中，本基金本报告期内无源自本基金托管人光大证券的银行存款及利息收入。

2、本基金证券资金户的存款为本基金存放于光大证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

3、本基金的基金合同生效日为2021年07月01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

本基金在本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。本基金的基金合同生效日为2021年07月01日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于浙商期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金不计息，存出保证金不计息。于2022年6月30日，本基金的结算备付金余额为1,334,519.80元。无存出保证金余额。于2021年12月31日，本基金的结算备付金余额为9,480,601.22元，无存出保证金余额。本基金的基金合同生效日为2021年07月01日，无上年度可比期间数据。

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，本基金本报告期内未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688234	天岳先进	2022-01-	7个月	科创板打	82.79	65.19	966	79,975.1	62,973.5	-

		05		新限售				4	4	
688237	超卓航科	2022-06-24	6个交易日	新股未上市	41.27	41.27	1,334	55,054.18	55,054.18	-
688306	均普智能	2022-03-15	7个月	科创板打新限售	5.08	5.19	9,868	50,129.44	51,214.92	-
688400	凌云光	2022-06-27	8个交易日	新股未上市	21.93	21.93	2,260	49,561.80	49,561.80	-
688173	希荻微	2022-01-13	7个月	科创板打新限售	33.57	31.62	1,158	38,874.06	36,615.96	-
301116	益客食品	2022-01-10	7个月	创业板打新限售	11.40	20.46	469	5,346.60	9,595.74	-
301130	西点药业	2022-02-16	7个月	创业板打新限售	22.55	37.70	204	4,600.20	7,690.80	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	7个月	创业板打新限售	46.80	54.44	113	5,288.40	6,151.72	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	7个月	创业板打新限售	56.88	56.42	101	5,744.88	5,698.42	-
301206	三元生物	2022-01-	7个月	创业板打	72.87	45.69	102	7,432.40	4,660.38	-

		26		新限售						
301200	大族数控	2022-02-18	7个月	创业板打新限售	76.56	51.92	86	6,584.16	4,465.12	-
301123	奕东电子	2022-01-14	7个月	创业板打新限售	37.23	25.39	146	5,435.58	3,706.94	-
301181	标榜股份	2022-02-11	7个月	创业板打新限售	40.25	30.59	110	4,427.50	3,364.90	-
300834	星辉环材	2022-01-06	7个月	创业板打新限售	55.57	30.03	85	4,723.45	2,552.55	-
301196	唯科科技	2022-01-04	7个月	创业板打新限售	64.08	37.52	55	3,524.40	2,063.60	-

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2022年6月30日止，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除6.4.12列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 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	14,860, 464.09	-	-	-	-	14,860,464.0 9
结算备付 金	1,334,5 19.80	-	-	-	-	1,334,519.80
交易性金 融资产	140,42 0,054.7 5	-	-	-	-	140,420,054. 75
资产总计	156,61	0.00	0.00	0.00	0.00	156,615,038.

	5,038.64					64
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	156,615,038.64	0.00	0.00	0.00	0.00	156,615,038.64
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	
银行存款	729,783.84	-	-	-	-	729,783.84
结算备付金	9,480,601.22	-	-	-	-	9,480,601.22
存出保证金	19,629,771.71	-	-	-	-	19,629,771.71
交易性金融资产	158,271,421.83	-	-	-	-	158,271,421.83
资产总计	188,111,578.60	0.00	0.00	0.00	0.00	188,111,578.60
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	188,111,578.60	0.00	0.00	0.00	0.00	188,111,578.60

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组

合资产的流动性风险进行管理，通过独立的合规风控部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	14,860,464.09	-	-	-	-	-	14,860,464.09
结算备付金	1,334,519.80	-	-	-	-	-	1,334,519.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	140,420,054.75	140,420,054.75
应收申购款	-	-	-	-	-	13,039.96	13,039.96
资产总计	16,194,983.89	-	-	-	-	140,433,094.71	156,628,078.60
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	134,581.01	134,581.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	185,379.95	185,379.95
应付托管费	-	-	-	-	-	24,717.33	24,717.33

应付销售服务费	-	-	-	-	-	18,844.63	18,844.63
其他负债	-	-	-	-	-	180,727.09	180,727.09
负债总计	-	-	-	-	-	544,250.01	544,250.01
利率敏感度缺口	16,194,983.89	-	-	-	-	139,888,844.70	156,083,828.59
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	729,783.84	-	-	-	-	-	729,783.84
结算备付金	9,480,601.22	-	-	-	-	-	9,480,601.22
存出保证金	19,629,771.71	-	-	-	-	-	19,629,771.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	158,271,421.83	158,271,421.83
应收利息	-	-	-	-	-	3,650.50	3,650.50
应收申购款	-	-	-	-	-	106,420.24	106,420.24
资产总计	29,840,156.77	-	-	-	-	158,381,492.57	188,221,649.34
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	912,760.00	912,760.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	360,977.96	360,977.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	239,855.82	239,855.82
应付托管费	-	-	-	-	-	31,980.78	31,980.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	23,825.71	23,825.71
应交税费	-	-	-	-	-	29,775.47	29,775.47
其他负债	-	-	-	-	-	143,576.23	143,576.23
负债总计	-	-	-	-	-	1,742,751.97	1,742,751.97
利率敏感度缺	29,840,156.77	-	-	-	-	156,638,740.60	186,478,897.37

口							
---	--	--	--	--	--	--	--

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末本基金未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	140,420,054.75	89.96	158,271,421.83	84.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	140,420,054.75	89.96	158,271,421.83	84.46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深300指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3、Beta系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去100个交易日与其对应的指数数据回归加权得出。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1、沪深300指数上涨5%	7,103,501.42	5,127,579.69
	2、沪深300指数下跌5%	-7,103,501.42	-5,127,579.69

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	置信区间为95%		
	观察期为180天		
分析	风险价值	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	风险价值	-4,110,319.49	-2,756,858.04
	合计	-4,110,319.49	-2,756,858.04

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	上年度末 2021年12月31日
第一层次	140,114,684.18	157,878,876.25
第二层次	104,615.98	65,068.73
第三层次	200,754.59	327,476.85
合计	140,420,054.75	158,271,421.83

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	140,420,054.75	89.65
	其中：股票	140,420,054.75	89.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,194,983.89	10.34
8	其他各项资产	13,039.96	0.01
9	合计	156,628,078.60	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,924,524.00	4.44

C	制造业	85,446,443.37	54.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,722,295.00	3.03
E	建筑业	347,854.00	0.22
F	批发和零售业	5,875,466.12	3.76
G	交通运输、仓储和邮政业	2,082,046.00	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,817,226.06	8.21
J	金融业	10,621,551.20	6.81
K	房地产业	2,468,636.00	1.58
L	租赁和商务服务业	2,108,969.00	1.35
M	科学研究和技术服务业	115,555.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,756,944.00	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,884,660.00	1.21
R	文化、体育和娱乐业	3,247,885.00	2.08
S	综合	-	-
	合计	140,420,054.75	89.96

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300769	德方纳米	7,020	2,868,933.60	1.84
2	000970	中科三环	148,400	2,786,952.00	1.79
3	300803	指南针	43,200	2,539,296.00	1.63
4	000729	燕京啤酒	246,200	2,378,292.00	1.52

5	600392	盛和资源	100,800	2,278,080.00	1.46
6	002268	卫士通	52,000	2,231,320.00	1.43
7	300037	新宙邦	42,360	2,226,441.60	1.43
8	300401	花园生物	126,300	2,190,042.00	1.40
9	600348	华阳股份	141,500	2,187,590.00	1.40
10	300775	三角防务	44,300	2,133,045.00	1.37
11	600873	梅花生物	188,900	2,130,792.00	1.37
12	600566	济川药业	77,700	2,110,332.00	1.35
13	601689	拓普集团	30,800	2,107,644.00	1.35
14	603444	吉比特	5,400	2,095,200.00	1.34
15	601958	金钼股份	236,400	2,089,776.00	1.34
16	600546	山煤国际	106,100	2,064,706.00	1.32
17	603198	迎驾贡酒	31,300	2,038,882.00	1.31
18	002797	第一创业	318,000	2,038,380.00	1.31
19	000629	攀钢钒钛	534,000	2,029,200.00	1.30
20	603613	国联股份	22,830	2,022,738.00	1.30
21	603605	珀莱雅	11,960	1,975,552.80	1.27
22	603379	三美股份	88,600	1,971,350.00	1.26
23	688536	思瑞浦	3,500	1,965,565.00	1.26
24	000733	振华科技	14,400	1,957,968.00	1.25
25	300418	昆仑万维	120,700	1,931,200.00	1.24
26	300618	寒锐钴业	33,100	1,917,152.00	1.23
27	002468	申通快递	160,800	1,916,736.00	1.23
28	300244	迪安诊断	60,600	1,884,660.00	1.21
29	000050	深天马 A	188,400	1,878,348.00	1.20
30	002948	青岛银行	516,860	1,871,033.20	1.20
31	002645	华宏科技	85,700	1,869,974.00	1.20
32	600535	天士力	177,400	1,864,474.00	1.19
33	000060	中金岭南	416,400	1,857,144.00	1.19
34	600380	健康元	150,000	1,852,500.00	1.19
35	002396	星网锐捷	81,800	1,851,952.00	1.19

36	600639	浦东金桥	136,200	1,850,958.00	1.19
37	002010	传化智联	286,800	1,844,124.00	1.18
38	603599	广信股份	65,240	1,836,506.00	1.18
39	601187	厦门银行	304,700	1,816,012.00	1.16
40	600867	通化东宝	175,500	1,814,670.00	1.16
41	000039	中集集团	130,800	1,811,580.00	1.16
42	600060	海信视像	144,500	1,806,250.00	1.16
43	300833	浩洋股份	20,600	1,795,496.00	1.15
44	000960	锡业股份	106,600	1,787,682.00	1.15
45	600885	宏发股份	42,700	1,786,995.00	1.14
46	600008	首创环保	613,200	1,778,280.00	1.14
47	002573	清新环境	302,400	1,756,944.00	1.13
48	600282	南钢股份	555,600	1,750,140.00	1.12
49	600863	内蒙华电	463,100	1,690,315.00	1.08
50	688099	晶晨股份	16,620	1,678,620.00	1.08
51	601098	中南传媒	177,500	1,675,600.00	1.07
52	600582	天地科技	349,200	1,669,176.00	1.07
53	601699	潞安环能	113,700	1,662,294.00	1.07
54	603868	飞科电器	21,600	1,636,200.00	1.05
55	688556	高测股份	20,200	1,630,140.00	1.04
56	000830	鲁西化工	93,700	1,620,073.00	1.04
57	600481	双良节能	94,800	1,597,380.00	1.02
58	600353	旭光电子	178,500	1,586,865.00	1.02
59	002416	爱施德	170,400	1,584,720.00	1.02
60	601928	凤凰传媒	219,900	1,572,285.00	1.01
61	002966	苏州银行	250,370	1,527,257.00	0.98
62	600153	建发股份	116,800	1,526,576.00	0.98
63	300661	圣邦股份	8,250	1,501,665.00	0.96
64	600808	马钢股份	375,800	1,424,282.00	0.91
65	300009	安科生物	137,300	1,388,103.00	0.89
66	688123	聚辰股份	12,800	1,363,456.00	0.87

67	000519	中兵红箭	39,300	1,145,595.00	0.73
68	688408	中信博	8,200	758,336.00	0.49
69	603990	麦迪科技	37,830	735,793.50	0.47
70	600256	广汇能源	66,000	695,640.00	0.45
71	002545	东方铁塔	59,300	674,834.00	0.43
72	000883	湖北能源	130,000	664,300.00	0.43
73	605222	起帆电缆	28,800	655,776.00	0.42
74	600901	江苏租赁	111,600	572,508.00	0.37
75	001914	招商积余	30,400	546,288.00	0.35
76	300763	锦浪科技	2,200	468,600.00	0.30
77	000963	华东医药	10,000	451,600.00	0.29
78	603693	江苏新能	22,000	422,400.00	0.27
79	300363	博腾股份	5,300	413,347.00	0.26
80	002829	星网宇达	13,000	396,500.00	0.25
81	601669	中国电建	44,200	347,854.00	0.22
82	300115	长盈精密	32,500	335,075.00	0.21
83	605286	同力日升	8,000	323,600.00	0.21
84	000983	山西焦煤	21,600	289,224.00	0.19
85	002056	横店东磁	10,000	266,200.00	0.17
86	300280	紫天科技	11,500	264,845.00	0.17
87	688599	天合光能	4,000	261,000.00	0.17
88	002415	海康威视	7,000	253,400.00	0.16
89	603879	永悦科技	36,000	246,240.00	0.16
90	300118	东方日升	8,200	240,506.00	0.15
91	300896	爱美客	400	240,004.00	0.15
92	300756	金马游乐	15,000	240,000.00	0.15
93	603330	上海天洋	20,300	239,743.00	0.15
94	002850	科达利	1,419	225,621.00	0.14
95	600929	雪天盐业	22,500	208,800.00	0.13
96	601012	隆基绿能	2,800	186,564.00	0.12
97	000591	太阳能	20,000	167,000.00	0.11

98	603303	得邦照明	10,800	166,428.00	0.11
99	603688	石英股份	1,200	159,132.00	0.10
100	603185	上机数控	1,000	155,990.00	0.10
101	000048	京基智农	8,100	150,417.00	0.10
102	600648	外高桥	11,000	149,600.00	0.10
103	601601	中国太保	5,500	129,415.00	0.08
104	688390	固德威	400	125,204.00	0.08
105	600600	青岛啤酒	1,200	124,704.00	0.08
106	603018	华设集团	12,100	115,555.00	0.07
107	603392	万泰生物	650	100,945.00	0.06
108	601336	新华保险	3,000	96,570.00	0.06
109	002264	新华都	18,000	89,640.00	0.06
110	601326	秦港股份	30,000	84,900.00	0.05
111	600029	南方航空	11,000	80,410.00	0.05
112	000069	华侨城 A	11,000	71,390.00	0.05
113	603629	利通电子	4,200	66,612.00	0.04
114	688234	天岳先进	966	62,973.54	0.04
115	301117	佳缘科技	1,121	62,529.16	0.04
116	002805	丰元股份	1,000	61,900.00	0.04
117	688520	神州细胞	1,152	59,592.96	0.04
118	688237	超卓航科	1,334	55,054.18	0.04
119	002815	崇达技术	4,000	51,240.00	0.03
120	688306	均普智能	9,868	51,214.92	0.03
121	688400	凌云光	2,260	49,561.80	0.03
122	688227	品高股份	2,082	44,596.44	0.03
123	688173	希荻微	1,158	36,615.96	0.02
124	601628	中国人寿	1,000	31,080.00	0.02
125	300568	星源材质	1,000	29,040.00	0.02
126	688800	瑞可达	200	25,262.00	0.02
127	300776	帝尔激光	100	17,280.00	0.01
128	300496	中科创达	100	13,048.00	0.01

129	301116	益客食品	469	9,595.74	0.01
130	301130	西点药业	231	8,770.80	0.01
131	301166	优宁维	142	8,358.12	0.01
132	301200	大族数控	156	8,245.12	0.01
133	603806	福斯特	100	6,552.00	0.00
134	301181	标榜股份	198	6,190.58	0.00
135	301207	华兰疫苗	103	5,817.24	0.00
136	301190	善水科技	203	4,817.19	0.00
137	301206	三元生物	102	4,660.38	0.00
138	301100	风光股份	206	4,445.48	0.00
139	301123	奕东电子	155	3,942.29	0.00
140	002984	森麒麟	100	3,111.00	0.00
141	300834	星辉环材	85	2,552.55	0.00
142	301196	唯科科技	55	2,063.60	0.00
143	002215	诺普信	300	1,677.00	0.00
144	600653	申华控股	100	266.00	0.00

注：对于同时在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300474	景嘉微	4,801,362.00	2.56
2	601098	中南传媒	4,517,961.00	2.41
3	688536	思瑞浦	4,400,231.55	2.35
4	300630	普利制药	4,051,256.00	2.16
5	002797	第一创业	4,033,380.00	2.15
6	600535	天士力	3,974,349.00	2.12
7	600282	南钢股份	3,939,249.00	2.10

8	000050	深天马 A	3,908,839.00	2.09
9	000733	振华科技	3,894,706.00	2.08
10	603599	广信股份	3,865,606.00	2.06
11	002966	苏州银行	3,842,735.00	2.05
12	600160	巨化股份	3,830,524.91	2.04
13	688029	南微医学	3,808,964.25	2.03
14	600500	中化国际	3,803,953.00	2.03
15	600325	华发股份	3,799,286.00	2.03
16	600582	天地科技	3,718,751.00	1.98
17	000039	中集集团	3,715,473.00	1.98
18	000830	鲁西化工	3,684,425.00	1.97
19	002850	科达利	3,535,277.54	1.89
20	603267	鸿远电子	3,520,647.00	1.88

注：1、表中买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、表中“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002603	以岭药业	6,165,417.80	3.29
2	601339	百隆东方	4,552,362.00	2.43
3	300133	华策影视	4,522,685.00	2.41
4	300171	东富龙	4,366,444.00	2.33
5	002266	浙富控股	4,274,956.00	2.28
6	603599	广信股份	4,245,334.00	2.27
7	600582	天地科技	4,191,471.00	2.24
8	000830	鲁西化工	4,185,587.00	2.23
9	600859	王府井	4,079,755.00	2.18
10	600481	双良节能	3,980,678.00	2.12

11	600160	巨化股份	3,944,115.00	2.10
12	000039	中集集团	3,878,432.40	2.07
13	000898	鞍钢股份	3,854,117.00	2.06
14	600325	华发股份	3,787,358.00	2.02
15	600500	中化国际	3,667,812.00	1.96
16	300613	富瀚微	3,665,201.00	1.96
17	300474	景嘉微	3,561,968.22	1.90
18	000999	华润三九	3,543,653.00	1.89
19	600256	广汇能源	3,516,265.00	1.88
20	600718	东软集团	3,422,294.00	1.83

注：1、表中卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、表中“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	361,464,381.41
卖出股票收入（成交）总额	370,116,913.94

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、表中“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可以运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特征。

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，在本报告编制日以前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	13,039.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,039.96

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 汇金 量化 臻选 股票A	1,248	93,672.14	0.00	0.00%	116,902,836.11	100.00%
浙商 汇金 量化 臻选	840	61,268.17	2,472,350.68	4.80%	48,992,915.84	95.20%

股票C						
合计	2,088	80,636.06	2,472,350.68	1.47%	165,895,752.00	98.53%

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	浙商汇金量化臻选股票A	158,123.67	0.1353%
	浙商汇金量化臻选股票C	2,527,541.92	4.9112%
	合计	2,685,665.59	1.5951%

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	浙商汇金量化臻选股票A	0
	浙商汇金量化臻选股票C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	浙商汇金量化臻选股票A	0
	浙商汇金量化臻选股票C	0
	合计	0

注：本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	浙商汇金量化臻选股票 A	浙商汇金量化臻选股票 C
基金合同生效日(2021年07月01日)基金份额总额	178,503,720.77	106,913,056.76
本报告期期初基金份额总额	134,288,846.23	56,822,461.45
本报告期基金总申购份额	566,310.91	1,177,698.64
减：本报告期基金总赎回份额	17,952,321.03	6,534,893.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	116,902,836.11	51,465,266.52

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

本报告期内，本基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司无重大人事变动。

2022年1月25日，本基金托管人光大证券股份有限公司，李旭东不再担任资产托管部总经理，聘任刘晨为资产托管部副总经理（主持工作）。

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	
光大证券	2	729,748,035.99	100.00%	536,583.24	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	关于浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金参与浙商银行股份有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-17
2	浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金2021年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-22
3	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-02-12
4	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与南京苏宁基金销售有限公司	中国证监会规定媒介	2022-02-12

	费率优惠活动和开通定投业务的公告		
5	浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金关于聘任基金经理助理的公告	中国证监会规定媒介	2022-02-23
6	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银河证券股份有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-22
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中信建投证券股份有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-25
8	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳众禄基金销售股份有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-29
9	浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-30
10	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与上海利得基金销售有限公司费率优惠活动、定期定额投资业务和转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-07
11	浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金2022年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
12	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司易管家平台费率优惠活动和开通	中国证监会规定媒介	2022-05-07

	定期定额投资业务公告		
13	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
14	浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金招募说明书（更新）（2022年定期更新）	中国证监会规定媒介	2022-06-02
15	浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022-06-02
16	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
17	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
18	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
19	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-27

§ 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量化臻选股票型证券投资基金的文件；
《浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金基金合同》；
《浙商汇金量化臻选股票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。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二〇二二年八月三十日