

# 浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

## 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：中国农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。

基金托管人中国农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	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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§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	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 本报告期投资基金情况	50
7.13 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.9 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）	
基金主代码	013781	
基金运作方式	契约型、开放式；本基金B类基金份额每个开放日开放申购，但对每份基金份额设置一年的最短持有期限；在最短持有期限内投资者不能提出赎回申请；在最短持有期限到期后的下一个工作日（含）起，B类基金份额持有人可以提出赎回申请。本基金A类基金份额以定期开放方式运作，以三个月为一个封闭期，其进入开放期仅开放赎回，不开放申购。A类基金份额每个开放期时长为5个工作日，具体时间参见公告。	
基金合同生效日	2021年11月08日	
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	142,577,634.46份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B
下属分级基金的交易代码	013781	013782
报告期末下属分级基金的份额总额	58,800,488.59份	83,777,145.87份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的前提下，通过主动大类资产配置，优选基金投资组合，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略：通过宏观基本面分析和战术资产配置决策进行确定，同时随着市场环境变化、

	<p>政策变化对组合进行适时调整。其中宏观基本面分析采用多因素分析框架采取定量与定性相结合的分析方法，判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势，明确未来某一阶段的基金组合投资风格，并定期适时对组合风格进行战术性调整。战术资产配置决策是根据市场变化对战略资产配置决策结果的适时调整，达到把握时变性投资机会的目标。本基金进行战术资产配置决策主要依据美林投资时钟理论。</p> <p>2、基金筛选策略：本基金通过定量与定性相结合的方法对基金数据进行分析，深入评估标的基金的投资能力和业绩稳定性，最终选出具有业绩可持续性的优秀基金进入基金精选池。</p> <p>3、股票投资策略：本基金持“自下而上”的精选策略，采用定量分析与定性分析相结合的方法，精选个股。</p> <p>4、债券投资策略：综合运用久期管理、收益率曲线估值策略、类别配置策略和个券选择等多种策略，选择风险调整后收益较高的组合进行投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略：综合考虑宏观经济环境、资产池资产信用水平、资产池未来现金流偿债能力、资产支持证券市场的流动性和资产支持证券的收益率谨慎选择预期违约率和收益相匹配且预期违约损失可承受的资产支持证券。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深300指数收益率×50%+中债总财富指数（总值）收益率×50%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金属于“中等风险”品种，为混合型基金中基金（FOF），一般情况下，其长期风险收益特征高于债券型基金中基金（FOF）、债券型基金、货币市场型基金中基金（FOF）及货币市场基金，但低于股票型基金中基金（FOF）和股票型基金。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	浙江浙商证券资产管理有限 公司	中国农业银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	楼小平	秦一楠
	联系电话	0571-87903297	010-66060069
	电子邮箱	fund@stocke.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	95345	95599	
传真	0571-87902581	010-68121816	
注册地址	浙江省杭州市拱墅区天水巷2 5号	北京市东城区建国门内大街6 9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	北京市西城区复兴门内大街2 8号凯晨世贸中心东座F9	
邮政编码	310020	100031	
法定代表人	盛建龙	谷澍	

## 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	中国证券登记结算有限责任 公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
---------------	-----

	(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	浙商汇金卓越配置 一年持有混合（FO F）A	浙商汇金卓越配置 一年持有混合（FO F）B
本期已实现收益	-3,693,942.97	-5,105,225.89
本期利润	-9,718,914.64	-13,508,073.14
加权平均基金份额本期利润	-0.1651	-0.1614
本期加权平均净值利润率	-6.77%	-6.62%
本期基金份额净值增长率	-6.14%	-6.04%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	88,949,214.96	126,918,465.25
期末可供分配基金份额利润	1.5127	1.5150
期末基金资产净值	147,749,703.55	210,695,611.12
期末基金份额净值	2.5127	2.5150
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-5.44%	-5.36%

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（不包括公允价值变动收益）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T日的基金份额净值在所投资基金披露净值的当日（法定节假日顺延至第一个交易日）计算，并于T+2日公告。

5、自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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



浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）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	6.82%	0.84%	4.71%	0.53%	2.11%	0.31%
过去三个月	4.33%	1.00%	3.70%	0.71%	0.63%	0.29%
过去六个月	-6.14%	0.99%	-3.69%	0.73%	-2.45%	0.26%
自基金合同 生效起至今	-5.44%	0.89%	-2.13%	0.66%	-3.31%	0.23%

注：1、本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中债总财富指数（总值）收益率×50%。

其中，沪深 300 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。

中债总财富指数（总值）收益率由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖上海证券交易所、深圳证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%、50%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、自 2021 年 11 月 08 日起，浙商汇金 1 号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效。

浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B

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	6.84%	0.84%	4.71%	0.53%	2.13%	0.31%
过去三个月	4.39%	1.00%	3.70%	0.71%	0.69%	0.29%
过去六个月	-6.04%	0.99%	-3.69%	0.73%	-2.35%	0.26%
自基金合同 生效起至今	-5.36%	0.90%	-2.13%	0.66%	-3.23%	0.24%

注：1、本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中债总财富指数（总值）收益率×50%。

其中，沪深 300 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。

中债总财富指数（总值）收益率由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖上海证券交易所、深圳证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%、50%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、自 2021 年 11 月 08 日起，浙商汇金 1 号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效。

### 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：自 2021 年 11 月 08 日起，《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》生效，《浙商汇金 1 号集合资产管理合同》同时失效，浙商汇金 1 号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）。自基金合同生效日起至本报告期末不满一年。至本报告期末，本基金已完成建仓，但报告期末距建仓结束不满一年，建仓期为 2021 年 11 月 08 日-2022 年 05 月 07 日，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B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11月08日-2022年06月30日)



注：自 2021 年 11 月 08 日起，《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》生效，《浙商汇金 1 号集合资产管理合同》同时失效，浙商汇金 1 号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）。自基金合同生效日起至本报告期末不满一年。至本报告期末，本基金已完成建仓，但报告期末距建仓结束不满一年，建仓期为 2021 年 11 月 08 日-2022 年 05 月 07 日，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

## § 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。

#### 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		
宋青涛	本基金基金经理，资产配置部总经理助理，浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金经理	2021-11-08	-	12年	中国国籍，金融硕士，历任浙商证券研究所电子行业研究员、浙商证券自营业务股票和债券投资经理、浙商证券资产管理有限公司大宗商品和行业公司研究员，现任资产配置部总经理助理、浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金经理、浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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

回顾2022年上半年，我们将A股市场总体表现分为主线、次主线和机会线。主线是能源安全和粮食安全方向，次主线是稳增长方向，机会线是以新能源为核心代表的成长股超跌反弹。主线是在2月末俄乌战争爆发后才确立。稳增长板块实际上体现了更多的组合防御思维。真正的大机会是新能源为核心代表的成长方向超跌反弹，因此在二季度，我们对组合结构进行了调整，减少了大金融配置比例，加大了成长方向的配置力度，同时也提高了权益资产在组合中的比例。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A基金份额净值为2.5127元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.14%，同期业绩比较基准收益率为-3.69%；截至报告期末浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B基金份额净值为2.5150元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.04%，同期业绩比较基准收益率为-3.69%。

#### 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，我们认为“三条线”会所有变化，首先俄乌战争由于各种原因，战争继续扩大的可能性不高，因此能源安全和粮食安全有可能不会再成为市场下半年的主线。我们认为市场下半年主线或者核心词是“复苏”。宏观大环境的复苏将带动各行各业的盈利好转。因此，在此背景下，我们的基金组合将围绕“复苏”积极布局。具体操作上，我们会把权益资产占比维持在相对高位，同时提高泛消费类行业基金在组合中占比。

#### 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，本基金未对报告期内利润进行收益分配。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-浙江浙商证券资产管理有限公司2022年1月1日至2022年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，浙江浙商证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为，浙江浙商证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	25,346,972.90	17,668,419.83
结算备付金		506,339.50	291,807.63
存出保证金		37,547.73	35,910.34

交易性金融资产	6.4.7.2	326,076,646.38	344,893,897.41
其中：股票投资		6,611,720.00	3,969,300.00
基金投资		319,464,926.38	340,924,597.41
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		6,819,540.71	22,686,854.77
应收股利		-	2,846,620.00
应收申购款		5,150.30	2,763,174.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	7,764.32
资产总计		358,792,197.52	391,194,448.33
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-



应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		194,025.24	15,237,778.96
应付托管费		52,296.46	50,634.43
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	524,312.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	100,561.15	175,156.85
负债合计		346,882.85	15,987,882.35
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	142,577,634.46	140,164,154.86
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	215,867,680.21	235,042,411.12
净资产合计		358,445,314.67	375,206,565.98
负债和净资产总计		358,792,197.52	391,194,448.33

注：1、报告截止日2022年06月30日，浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）A基金份额净值2.5127元，基金份额总额58,800,488.59份。浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）B基金份额净值2.5150元，基金份额总额83,777,145.87份。

2、自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效。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上年度可比区间数据。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

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		-21,632,356.39

1. 利息收入		78,833.31
其中：存款利息收入	6.4.7.9	78,833.31
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）		-7,283,428.26
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-950,514.13
基金投资收益	6.4.7.11	-7,225,428.00
债券投资收益	6.4.7.12	65,306.16
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	827,207.71
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	-14,427,818.92
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	57.48
<b>减：二、营业总支出</b>		1,594,631.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,178,134.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	316,383.89
3. 销售服务费		-
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		15,749.81

8. 其他费用	6.4.7.20	84,363.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-23,226,987.78
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,226,987.78
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-23,226,987.78

注：自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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上年度可比区间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

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）	140,164,154.86	-	235,042,411.12	375,206,565.98
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）	140,164,154.86	-	235,042,411.12	375,206,565.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,413,479.60	-	-19,174,730.91	-16,761,251.31
（一）、综合收益总额	-	-	-23,226,987.78	-23,226,987.78

（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）	2,413,479.60	-	4,052,256.87	6,465,736.47
其中：1. 基金申购款	2,689,043.60	-	4,463,675.19	7,152,718.79
2. 基金赎回款	-275,564.00	-	-411,418.32	-686,982.32
（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）	142,577,634.46	-	215,867,680.21	358,445,314.67

注：自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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上年度可比区间数据。

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1号集合资产管理计划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]2904号）《关于准予浙商汇金1号集合资产管理计划变更注册的批复》批准，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告[2018]39号），变更注册为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）（简称“本基金”）。自2021年11月08日起，《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》生效，《浙商汇金1号集合资产

管理合同》同时失效。基金合同生效日的基金份额总额为71,495,014.17份基金份额，其中浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）A基金份额总额71,495,014.17份，浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）B基金份额总额0.00份。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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农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《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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01月01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 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 2022年06月30日
活期存款	25,346,972.90
等于：本金	25,342,074.76
加：应计利息	4,898.14
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	25,346,972.90

#### 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	6,578,495.75	-	6,611,720.00	33,224.25
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	321,772,272.39	-	319,464,926.38	-2,307,346.01
其他	-	-	-	-
合计	328,350,768.14	-	326,076,646.38	-2,274,121.76

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	19,978.14
其中：交易所市场	19,978.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,583.01
合计	100,561.15

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A

金额单位：人民币元

项目 (浙商汇金卓越配置一年持有 混合（FOF）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	59,076,052.59	59,076,052.59
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-275,564.00	-275,564.00
本期末	58,800,488.59	58,800,488.59

#### 6.4.7.7.2 浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B

金额单位：人民币元

项目 (浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B)	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	81,088,102.27	81,088,102.27
本期申购	2,689,043.60	2,689,043.60
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	83,777,145.87	83,777,145.87

注：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 浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A

单位：人民币元

项目 (浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	116,318,648.40	-17,239,100.48	99,079,547.92
本期利润	-3,693,942.97	-6,024,971.67	-9,718,914.64
本期基金份额交易产生的变动数	-547,752.73	136,334.41	-411,418.32
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-547,752.73	136,334.41	-411,418.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	112,076,952.70	-23,127,737.74	88,949,214.96

##### 6.4.7.8.2 浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B

单位：人民币元

项目 (浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	160,668,047.93	-24,705,184.73	135,962,863.20
本期利润	-5,105,225.89	-8,402,847.25	-13,508,073.14
本期基金份额交易产生的变动数	5,309,943.04	-846,267.85	4,463,675.19
其中：基金申购款	5,309,943.04	-846,267.85	4,463,675.19
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	160,872,765.08	-33,954,299.83	126,918,465.25

#### 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	76,445.06
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	2,013.46
其他	374.79
合计	78,833.31

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	35,150,612.21
减：卖出股票成本总额	36,006,179.27
减：交易费用	94,947.07

买卖股票差价收入	-950,514.13
----------	-------------

#### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	129,649,489.00
减：卖出/赎回基金成本总额	136,527,191.48
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	131,248.33
减：交易费用	216,477.19
基金投资收益	-7,225,428.00

#### 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01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	44,255.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,050.80
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	65,306.16

##### 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01月01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	15,135,651.43
减：卖出债券（债	15,003,000.00

转股及债券到期兑 付) 成本总额	
减：应计利息总额	111,570.43
减：交易费用	30.20
买卖债券差价收入	21,050.80

#### 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

本基金本报告期末进行贵金属投资。

#### 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

本基金本报告期末进行权证投资。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末进行其他衍生工具投资。

#### 6.4.7.16 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	249,026.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	578,181.71
合计	827,207.71

#### 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	-14,839,024.73

——股票投资	73,737.50
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-14,912,762.23
——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	-411,205.81
合计	-14,427,818.92

#### 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	57.48
合计	57.48

#### 6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2022年01月01日至2022年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,544,568.07
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	280,355.53

注：1、当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

2、根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 6.4.7.20 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	-
汇划手续费	3,780.53
合计	84,363.54

#### 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、基金销售机构
中国农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

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
浙商证券股份有限 公司	53,118,867.82	72.05%

注：自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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。自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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01月01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	30,027,081.00	100.00%

注：自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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。自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

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	占当期基金成交总额的比例
浙商证券股份有限公司	136,960,439.42	100.00%

注：自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占期末应付佣金总额的比例
浙商证券股份有限公司	38,847.91	72.3	5,149.79	25.7

		7%		8%
--	--	----	--	----

注：1、自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，无上年度可比期间数据。  
2、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,178,134.15
其中：支付销售机构的客户维护费	574,188.45

注：1、基金管理人的固定管理费

（1）不同类别份额的固定管理费分别计算，从相应类别份额的资产净值计提。

A类基金份额0.8%/年；B类基金份额0.6%/年

（2）固定管理费计算

本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取固定管理费。本基金的固定管理费按前一日该类基金资产净值扣除前一日该类基金份额按比例所持有本基金管理人管理的其他基金部分所对应资产净值后的余额（若为负数，则取0）的该类基金份额相应固定管理费年费率计提。基金固定管理费的计算方法如下：

$H = E \times \text{该类基金份额固定管理费年费率} \div \text{当年天数}$

H为该类基金份额每日应计提的固定管理费，E为前一日的该类基金份额基金资产净值扣除前一日该类基金份额按比例所持有的本基金管理人管理的其他基金部分所对应资产净值后的余额，若为负数，则E取0。

（3）固定管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金管理人的业绩报酬

（1）A类基金份额业绩报酬

①A类基金份额业绩报酬计提日为本基金分红日、原浙商汇金1号集合资产管理计划成立之日起每满三个月的最后一个交易日。

②在A类基金份额业绩报酬计提日，对于A类基金份额累计净值（计提业绩报酬之前）高于之前各业绩报酬计提日单位累计净值（包括原浙商汇金1号集合资产管理计划存续期限内）的最高值，且高于1.10元时，基金管理人将对于A类基金份额提取业绩报酬，提取比例为A类基金份额累计净值（计提业绩报酬之前）与之前各业绩报酬计提日单位累计净值（包括原浙商汇金1号集合资产管理计划存续期限内）的最高值及1.10元两者中高者的差额部分的20%。

上述A类基金份额业绩报酬由基金管理人向基金托管人发送A类基金份额业绩报酬划付指令，由基金托管人于5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## （2）B类基金份额业绩报酬

### 1) B类基金份额业绩报酬提取原则

- ①按每笔申购B类基金份额（或红利再投份额）分别计算年化收益率并计提业绩报酬；
- ②业绩报酬计提基准日为基金分红除息日（若有）、B类基金份额赎回申请日和本基金最后运作日；业绩报酬计提日为基金分红确认日、B类基金份额赎回确认日或本基金最后运作日；
- ③基金分红确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金，分红日提取业绩报酬的频率原则上每年不超过1次；
- ④基金份额持有人申请赎回时，基金管理人按“先进先出”原则，对份额申购（申购 B类份额/红利再投B类份额）的先后次序进行确认赎回份额，计算、提取赎回份额对应业绩报酬。

### 2) B类基金份额业绩报酬的计提方法

基金管理人根据期间年化收益率对B类基金份额收益超过6%以上部分按照20%的比例收取基金管理人业绩报酬。

3、自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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	316,383.89

注：1、本基金对基金财产中持有的本基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金托管人自身托管的其他基金部分所对应资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的0.2%年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

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扣除前一日所持有的本基金托管人托管的其他基金部分对应资产净值后的余额，若为负数，则E取0。

基金托管费每日计算，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，由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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**

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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**

本基金在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。自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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**

本基金在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。自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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。自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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
中国农业银行股份有限公司	25,346,972.90	76,445.06

注：（1）本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

（2）自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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**

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，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****6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内未发生其他关联交易事项。自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

本报告期本基金未持有基金管理人以及基金管理人关联方所管理的基金。自2021年11月08日起，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF），新基金合同生效。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，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **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**

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农业银行，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**

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	25,346,972.90	-	-	-	-	25,346,972.90
结算备付金	506,339.50	-	-	-	-	506,339.50
存出保证金	37,547.73	-	-	-	-	37,547.73
交易性金融资产	6,611,720.00	-	-	-	-	6,611,720.00
债权投资	6,611,720.00	-	-	-	-	6,611,720.00
资产总计	39,114,300.13	-	-	-	-	39,114,300.13
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	39,114,300.13	-	-	-	-	39,114,300.13
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	17,668,419.83	-	-	-	-	17,668,419.83
结算备付金	291,807.63	-	-	-	-	291,807.63



存出保证金	35,910.34	-	-	-	-	35,910.34
交易性金融资产	3,969,300.00	-	-	-	-	3,969,300.00
资产总计	21,965,437.80	-	-	-	-	21,965,437.80
负债	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	21,965,437.80	-	-	-	-	21,965,437.80

#### 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	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
--------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）2022年中期报告

06月30日							
资产							
银行存款	25,346,972.90	-	-	-	-	-	25,346,972.90
结算备付金	506,339.50	-	-	-	-	-	506,339.50
存出保证金	37,547.73	-	-	-	-	-	37,547.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	326,076,646.38	326,076,646.38
应收清算款	-	-	-	-	-	6,819,540.71	6,819,540.71
应收申购款	-	-	-	-	-	5,150.30	5,150.30
资产总计	25,890,860.13	-	-	-	-	332,901,337.39	358,792,197.52
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	194,025.24	194,025.24
应付托管费	-	-	-	-	-	52,296.46	52,296.46
其他负债	-	-	-	-	-	100,561.15	100,561.15
负债总计	-	-	-	-	-	346,882.85	346,882.85
利率敏感度缺口	25,890,860.13	-	-	-	-	332,554,454.54	358,445,314.67
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	17,668,419.83	-	-	-	-	-	17,668,419.83
结算备付金	291,807.63	-	-	-	-	-	291,807.63
存出保证金	35,910.34	-	-	-	-	-	35,910.34
交易性金融资产	-	-	-	-	-	344,893,897.41	344,893,897.41
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,686,854.77	22,686,854.77
应收利息	-	-	-	-	-	7,764.32	7,764.32
应收股	-	-	-	-	-	2,846,620.00	2,846,620.00

利							
应收申购款	-	-	-	-	-	2,763,174.03	2,763,174.03
资产总计	17,996,137.80	-	-	-	-	373,198,310.53	391,194,448.33
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,237,778.96	15,237,778.96
应付托管费	-	-	-	-	-	50,634.43	50,634.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	32,656.85	32,656.85
应交税费	-	-	-	-	-	524,312.11	524,312.11
其他负债	-	-	-	-	-	142,500.00	142,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	15,987,882.35	15,987,882.35
利率敏感度缺口	17,996,137.80	-	-	-	-	357,210,428.18	375,206,565.98

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	6,611,720.00	1.84	3,969,300.00	1.06
交易性金融资产—基金投资	319,464,926.38	89.13	340,924,597.41	90.86
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	326,076,646.38	90.97	344,893,897.41	91.92

#### 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%	11,896,231.17	-
	2、沪深300指数下跌5%	-11,896,231.17	-

注：自2021年11月08日起，《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》生效，《浙商汇金1号集合资产管理合同》同时失效，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）。上年度末数据无。

#### 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	-6,083,836.33	-

注：自2021年11月08日起，《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》生效，《浙商汇金1号集合资产管理合同》同时失效，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）。上年度末数据无。

#### 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	326,076,646.38	344,893,897.41
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	326,076,646.38	344,893,897.41

#### 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	6,611,720.00	1.84
	其中：股票	6,611,720.00	1.84
2	基金投资	319,464,926.38	89.04
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	25,853,312.40	7.21
8	其他各项资产	6,862,238.74	1.91
9	合计	358,792,197.52	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,623,560.00	1.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	2,988,160.00	0.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,611,720.00	1.84

### 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	603225	新凤鸣	314,000	3,623,560.00	1.01
2	601318	中国平安	64,000	2,988,160.00	0.83

### 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	301216	万凯新材	7,296,953.77	1.94
2	601318	中国平安	6,821,207.00	1.82
3	601233	桐昆股份	6,557,753.00	1.75
4	601939	建设银行	3,887,083.00	1.04
5	002353	杰瑞股份	3,610,372.00	0.96
6	601857	中国石油	3,608,292.00	0.96
7	603225	新凤鸣	3,464,678.00	0.92
8	600938	中国海油	3,328,523.00	0.89

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	601233	桐昆股份	7,132,951.02	1.90
2	301216	万凯新材	7,037,135.39	1.88
3	601939	建设银行	3,805,200.00	1.01
4	600938	中国海油	3,767,615.00	1.00
5	600309	万华化学	3,630,769.00	0.97
6	601318	中国平安	3,576,382.80	0.95
7	601857	中国石油	3,538,414.00	0.94
8	002353	杰瑞股份	2,662,145.00	0.71

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	38,574,861.77
卖出股票收入（成交）总额	35,150,612.21

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

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 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为股票型基金中基金，投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的比例不低于基金资产的80%，其中投资于股票型基金（包括股票指数基金）的资产占基金资产的比例不低于80%；本基金在合理控制风险的前提下，通过优选基金投资组合，力求基金资产的长期稳健增值。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，所投资的子基金整体运作情况良好。本基金的投资符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产	是否属于基金

						产净值比例(%)	管理人及管理人关联方所管理的基金
1	515220	煤炭ETF	交易型 开放式	11,703,20 0.00	29,164,37 4.40	8.14	否
2	501022	银华鑫盛灵活配置混合(LOF)A	契约型 开放式	10,030,15 0.65	23,520,70 3.27	6.56	否
3	512980	传媒ETF	交易型 开放式	34,141,40 0.00	21,952,92 0.20	6.12	否
4	000251	工银金融地产混合A	契约型 开放式	7,170,31 0.27	18,922,44 8.80	5.28	否
5	516110	汽车ETF	交易型 开放式	14,482,30 0.00	17,624,95 9.10	4.92	否
6	519782	交银裕隆纯债债券A	契约型 开放式	13,482,03 9.36	17,317,67 9.56	4.83	否
7	519718	交银纯债债券发起A/B	契约型 开放式	13,895,15 6.05	15,038,72 7.39	4.20	否
8	159928	消费ETF	交易型 开放式	12,841,60 0.00	14,844,88 9.60	4.14	否
9	519714	交银消费新驱动股票	契约型 开放式	7,125,67 3.82	14,572,00 2.96	4.07	否
10	519133	海富通改革驱动混合	契约型 开放式	5,016,98 7.05	13,793,20 2.50	3.85	否
11	005825	申万菱信智能驱动股票A	契约型 开放式	3,605,64 2.33	13,124,53 8.08	3.66	否
12	006392	中信保诚创新成长混合A	契约型 开放式	3,801,61 8.60	12,983,28 7.84	3.62	否
13	512690	酒ETF	交易型 开放式	12,281,50 0.00	11,458,63 9.50	3.20	否

14	519915	富国消费主题混合A	契约型 开放式	3,586,48 0.48	10,576,53 0.94	2.95	否
15	003327	万家鑫璟纯债债券A	契约型 开放式	8,440,35 6.58	10,154,59 3.00	2.83	否
16	515790	光伏ETF	交易型 开放式	5,963,93 2.00	10,090,97 2.94	2.82	否
17	540003	汇丰晋信动态策略混合A	契约型 开放式	1,975,25 1.80	9,642,58 6.71	2.69	否
18	007130	中庚小盘价值股票	契约型 开放式	3,580,43 2.60	8,043,44 1.84	2.24	否
19	001822	华商智能生活灵活配置混合A	契约型 开放式	2,856,33 9.71	7,997,75 1.19	2.23	否
20	000186	华泰柏瑞季季红债券A	契约型 开放式	7,000,00 0.00	7,486,50 0.00	2.09	否
21	512170	医疗ETF	交易型 开放式	11,860,10 0.00	6,878,85 8.00	1.92	否
22	100066	富国纯债债券发起A	契约型 开放式	5,175,75 9.04	5,683,50 1.00	1.59	否
23	005711	永赢惠添利灵活配置混合	契约型 开放式	2,805,27 6.37	5,093,54 0.31	1.42	否
24	006257	信澳先进智造股票	契约型 开放式	1,633,74 8.52	4,745,22 2.58	1.32	否
25	005235	银华食品饮料量化股票发起式A	契约型 开放式	1,798,58 9.62	4,612,12 3.36	1.29	否
26	001171	工银养老产业股票A	契约型 开放式	2,237,13 1.99	4,140,93 1.31	1.16	否

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	37,547.73
2	应收清算款	6,819,540.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,150.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,862,238.74

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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	持有份额	占总份 额比例

				比例		
浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	375	156,801.30	7,258,541.12	12.34%	51,541,947.47	87.66%
浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B	3,100	27,024.89	574,996.72	0.69%	83,202,149.15	99.31%
合计	3,475	41,029.54	7,833,537.84	5.49%	134,744,096.60	94.51%

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	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	-	-
	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B	642,968.56	0.7675%
	合计	642,968.56	0.4510%

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	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	0
	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	0
	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B	0
	合计	0

注：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

	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B
基金合同生效日（2021年11月08日）基金份额总额	59,076,052.59	-
本报告期期初基金份额总额	59,076,052.59	81,088,102.27
本报告期基金总申购份额	-	2,689,043.60
减：本报告期基金总赎回份额	275,564.00	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	58,800,488.59	83,777,145.87

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，基金管理人无重大人事变动。

2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

### 10.6 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。

### 10.7 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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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	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	佣金	占当期佣金总量的比	



	数量		的比例		例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	20,606,606.16	27.95%	14,828.35	27.63%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	53,118,867.82	72.05%	38,847.91	72.37%	-

注：a)截至报告期末，本公司已在上海交易所、深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。本报告期内，本基金交易单元无变更。

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

- 1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金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。

### 10.8.2 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

				比例				
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	30,027,081.00	100.00%	-	-	-	-	136,960,439.42	100.00%

### 10.9 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	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）A类份额开放日常赎回业务公告	中国证监会规定媒介	2022-01-29
2	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）2022年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
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宁波银行股份有限公司易管家平台费率优惠活动和开通定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2022-05-07
4	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）A类份额开放日常赎回业务公告	中国证监会规定媒介	2022-05-10

## § 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

关于准予浙商汇金1号集合资产管理计划变更注册的批复；

《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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、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