

浙商汇金卓越优选 3 个月持有期股票型基金中基金（FOF）

2023 年中期报告

2023 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:2023 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2023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2023年01月01日起至2023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 | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 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 | 13 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 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 | 13 |
| 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 | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| §7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 43 |
| 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 | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 45 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 47 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 47 |
| 7.12 本报告期投资基金情况 | 48 |
| 7.13 投资组合报告附注 | 49 |
| §8 基金份额持有人信息 | 50 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 50 |

| | |
|---|----|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 50 |
| 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..... | 51 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 51 |
| §10 重大事件揭示..... | 51 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 52 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 52 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件..... | 52 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 52 |
| 10.9 其他重大事件..... | 54 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 55 |
| 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..... | 55 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 56 |
| §12 备查文件目录..... | 56 |
| 12.1 备查文件目录..... | 56 |
| 12.2 存放地点..... | 56 |
| 12.3 查阅方式..... | 56 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---|
| 基金名称 | 浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF） |
| 基金简称 | 浙商汇金卓越优选3个月 |
| 基金主代码 | 009113 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式；本基金对每份基金份额设置3个月的最短持有期限，即自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日3个月后的月度对日的期间内，投资者不能提出赎回申请；该日3个月后的月度对日之后，投资者可以提出赎回申请。如该对应日期为非工作日，则顺延至下一工作日，若该日历年中不存在对应日期的，则顺延至该月最后一日的下一工作日。 |
| 基金合同生效日 | 2020年05月15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 | 24,686,968.96份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

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 | <p>本基金的投资策略为：首先，依据宏观预判确定基金组合风格配置方案；而后，利用基金筛选策略优选各个风格中的基金构筑投资组合。基金经理将定期及不定期对组合投资情况进行业绩归因，适时进行组合战术调整和基金品种调整。</p> <p>（一）基于宏观动态的风格配置策略； （二）基金筛选策略； （三）股票投资策略； （四）债券投资策略； （五）资产支持证券投资策略；</p> |

| | |
|--------|--|
| | (六) 其他。 |
| 业绩比较基准 | 中证800指数收益率×80%+中债综合财富指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金属于“中高风险”品种，为股票型基金中基金（FOF），一般而言，其长期风险收益特征高于混合型基金中基金（FOF）、混合型基金、债券型基金中基金（FOF）、债券型基金和货币市场型基金中基金（FOF）及货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|--------------------------|---------------------------|
| 名称 | | 浙江浙商证券资产管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨锴 | 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25号 | 北京市东城区建国门内大街69号 |
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街28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 | 中国证券报 |
| 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 (2023年01月01日- 2023年06月30日) | |
|---------------|-----------------------------------|---------------|
| | 本期已实现收益 | -1,400,777.43 |
| 本期利润 | -1,508,624.19 | |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0573 | |
| 本期加权平均净值利润率 | -5.90% | |
| 本期基金份额净值增长率 | -6.08% | |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2023年06月30日) | |
| | 期末可供分配利润 | -2,322,214.05 |
| | 期末可供分配基金份额利润 | -0.0941 |
| | 期末基金资产净值 | 22,364,754.91 |
| | 期末基金份额净值 | 0.9059 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2023年06月30日) | |
| | 基金份额累计净值增长率 | -9.41% |

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、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。

4、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 1.71% | 0.98% | 0.60% | 0.69% | 1.11% | 0.29% |
| 过去三个月 | -7.91% | 0.83% | -3.84% | 0.64% | -4.07% | 0.19% |
| 过去六个月 | -6.08% | 0.85% | 0.60% | 0.64% | -6.68% | 0.21% |
| 过去一年 | -18.22% | 0.99% | -9.31% | 0.75% | -8.91% | 0.24% |
| 过去三年 | -11.93% | 1.14% | -1.41% | 0.93% | -10.52% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.41% | 1.11% | 3.32% | 0.92% | -12.73% | 0.19% |

注：本基金投资的业绩比较基准为：中证800指数收益率×80%+中债综合财富指数收益率×20%

中证800指数由中证500和沪深300指数成份股组成，综合反映中国A股市场大中小市值公司的股票价格表现。

中债-综合指数隶属于中债总指数族分类，该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行的债券，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，是中债指数应用最广泛指数之一。

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。

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

浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年05月15日-2023年06月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浙江浙商证券资产管理有限公司成立于2013年4月18日，是原浙商证券有限责任公司设立的全资子公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准浙商证券有限责任公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可（2012）1431号）批准，由浙商证券股份有限公司出资12亿元从事资产管理业务。2014年8月19日中国证券监督管理委员会批准《关于核准浙江浙商证券资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可（2014）857号）。公司主要经营范围涉及证券资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务。截止2023年6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、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、浙商汇金金算盘货币市场基金、浙商汇金聚瑞债券型证券投资基金、浙商汇金平稳增长一年持有期混合型证券投资基金和浙商汇金聚兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

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，浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理 | 2020-08-07 | - | 13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：1、上述表格内基金经理的任职日期、离职日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

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

回顾2023年上半年，2月底是A股市场风格变化的重要时间点。在这之前，A股市场偏向于复苏逻辑下的顺周期机会，而在这之后，市场逐渐切入弱复苏下成长股或者主题投资行情。

开年以来，本基金组合结构偏向于顺周期，与当时市场风格比较契合，因此在2月底之前本基金业绩排名相对同类型较优。但是进入3月份后，由于复苏力度开始减弱，甚至出现低于预期迹象，导致顺周期上市公司Q2业绩低于预期的可能性不断上升，因此市场风格发生了巨大变化。与此同时，在金融市场整体流动性不错背景下，3月份之后有着巨大想象空间的AIGC板块在行业事件不断催化下，推动市场对该板块的热情。本

基金在Q2未能及时调整组合结构，因此并未把握住本次AI板块性机会，基金业绩排名出现明显下滑。

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优选3个月基金份额净值为0.9059元，本报告期内，基金份额净值增长率为-6.08%，同期业绩比较基准收益率为0.60%。

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，随着国内工业企业产成品库存和PPI数据不断下行，市场开始关注库存周期的补库周期，恰逢9月和10月是工业企业产成品需求的季节性旺季，因此在自然库存周期基础上叠加一定的政策刺激，将有利于市场参与主体预期转变。此外，国内经济边际复苏的同时，美国货币政策存在不再趋紧的预期，因此国内利率将迎来阶段性拐点。这种情况会影响中美两国利差的边际变化，从而影响离岸人民币汇率预期，进而影响北向资金行为，而北向资金的行为又与顺周期板块关联度较高。所以，下半年本基金将保持偏向于顺周期的组合结构。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定及我司估值政策和程序，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金(FOF)基金合同》的约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；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；选择采取现金分红方式的，在该红利发放之日起 7 个工作日内，将现金红利扣除基金管理人应提业绩报酬（如有）后划转到基金份额持有人的基金交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金扣除基金管理人应提业绩报酬（如有）后按分红除息日各类基金份额的单位净值转成相应的基金份额；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。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运行情况，本基金在本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金于 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日持续出现基金净值低于 5000 万的情形，公司已向中国证监会报告并以通讯方式召开了基金份额持有人大会。会议投票表决起止时间自 2023 年 5 月 13 日起至 2023 年 6 月 8 日 17:00 止。本次会议未达到法定召开条件，会议详情请见 2023 年 6 月 10 日在规定媒介发布的《浙江浙商证券资产管理有限公司关于浙商汇金卓越优选 3 个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会会议情况的公告》。

§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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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：浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,627,217.50 | 2,824,726.34 |
| 结算备付金 | | 7,493.03 | 19,602.01 |
| 存出保证金 | | 1,996.33 | 4,619.65 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 20,753,153.40 | 23,448,409.53 |
| 其中：股票投资 | | 1,781,570.68 | 1,712,808.00 |
| 基金投资 | | 18,971,582.72 | 21,735,601.53 |
| 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 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 31,982.69 | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 39.97 | 9.99 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 0.00 |
| 资产总计 | | 22,421,882.92 | 26,297,367.52 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022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 | | 7,882.17 | 95,487.96 |
| 应付管理人报酬 | | 18,416.99 | 22,457.53 |
| 应付托管费 | | 3,683.40 | 4,491.52 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 27,145.45 | 138,491.71 |
| 负债合计 | | 57,128.01 | 260,928.72 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 24,686,968.96 | 26,995,620.16 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -2,322,214.05 | -959,181.36 |
| 净资产合计 | | 22,364,754.91 | 26,036,438.80 |
| 负债和净资产总计 | | 22,421,882.92 | 26,297,367.52 |

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值0.9059元，基金份额总额24,686,968.96份。

6.2 利润表

会计主体：浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023年01月01日至 2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日 |
|-----------------------|----------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | -1,312,305.68 | -3,188,848.89 |
| 1.利息收入 | | 7,452.12 | 9,435.79 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 7,452.12 | 9,435.79 |
| 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） | | -1,212,155.07 | 32,323.62 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -270,756.54 | 83,497.73 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | -948,956.45 | -59,234.47 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | - | 6,520.36 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.17 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.20 | 7,557.92 | 1,540.00 |
| 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 | 6.4.7.21 | -107,846.76 | -3,233,133.51 |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 以“-”号填列) | | | |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列) | 6.4.7.22 | 244.03 | 2,525.21 |
| 减：二、营业总支出 | | 196,318.51 | 297,611.02 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 126,976.40 | 195,270.02 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 25,395.24 | 36,955.26 |
| 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 | 6.4.7.24 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | 3,420.23 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.25 | 43,946.87 | 61,965.51 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列) | | -1,508,624.19 | -3,486,459.91 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列) | | -1,508,624.19 | -3,486,459.91 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -1,508,624.19 | -3,486,459.91 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | | |
|----|-------------------------|--------|-------|-------|
| | 2023年01月01日至2023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） | 26,995,620.16 | - | -959,181.36 | 26,036,438.80 |
| 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） | 26,995,620.16 | - | -959,181.36 | 26,036,438.80 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -2,308,651.20 | - | -1,363,032.69 | -3,671,683.89 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -1,508,624.19 | -1,508,624.19 |
| （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） | -2,308,651.20 | - | 145,591.50 | -2,163,059.70 |
| 其中：1.基金申购款 | 309,974.06 | - | -686.76 | 309,287.30 |
| 2.基金赎回款 | -2,618,625.26 | - | 146,278.26 | -2,472,347.00 |
| （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） | 24,686,968.96 | - | -2,322,214.05 | 22,364,754.91 |
| 项目 | 上年度可比期间 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） | 39,086,774.42 | - | 7,288,372.32 | 46,375,146.74 |
| 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） | 39,086,774.42 | - | 7,288,372.32 | 46,375,146.74 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -5,137,087.00 | - | -3,631,200.94 | -8,768,287.94 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -3,486,459.91 | -3,486,459.91 |
| （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） | -5,137,087.00 | - | -144,741.03 | -5,281,828.03 |
| 其中：1.基金申购款 | 301,774.18 | - | 23,546.88 | 325,321.06 |
| 2.基金 | -5,438,861.18 | - | -168,287.91 | -5,607,149.09 |

| | | | | |
|--|---------------|---|--------------|---------------|
| 赎回款 | | | | |
| （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） | 33,949,687.42 | - | 3,657,171.38 | 37,606,858.80 |

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

浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2019]2706号《关于准予浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）作为托管人，于2020年05月15日募集设立。浙商证券股份有限公司（以下简称“浙商证券”）是发售代理机构之一。本基金的募集期间为2020年4月21日至2020年5月12日止，本基金类型为股票型证券投资基金、基金中基金（FOF），基金的运作方式为契约型开放式，存续期为不定期。

根据《浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）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、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构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2020年5月14日止，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

人民币292,511,585.10元，该基金首次发行募集的实收基金（本金）折合份额为292,511,585.10份，募集期间产生的利息折合份额为7,596.81份，共计292,519,181.91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[2020]京会兴浙分验字第68000027号验资报告。

截至2023年06月30日，本基金有效份额总额为24,686,968.96份。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（不包括QDII基金和香港互认基金）的基金份额、国内依法公开发行上市交易的股票（包含主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（国债、金融债券、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具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的相关规定。

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。

基金的投资组合比例为：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%；本基金所持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

本基金业绩比较基准为：中证800指数收益率×80%+中债综合财富指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业

实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况、自2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策变更。

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

（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 2023年06月30日 | |
|--------------|--------------------|--------------|
| | 活期存款 | 1,627,217.50 |
| 等于：本金 | 1,626,877.17 | |
| 加：应计利息 | 340.33 | |
| 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 | 1,627,217.50 | |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 | | | |
|---------------|--------------------|------|--------------|-------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 1,883,845.34 | - | 1,781,570.68 | -102,274.66 |
| 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 | 21,558,855.18 | - | 18,971,582.72 | -2,587,272.46 |
| | 其他 | - | - | - | - |
| | 合计 | 23,442,700.52 | - | 20,753,153.40 | -2,689,547.12 |

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

本基金在本报告期末，未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金在本报告期末，未持有期货。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金在本报告期末，未持有黄金衍生品。

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

本基金在本报告期末，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

本基金在本报告期末，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金在本报告期末，未持有债权。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金在本报告期末，未持有债权。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金在本报告期末，未持有债权。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金在本报告期末，未持有债权。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金在本报告期末，未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金在本报告期内，未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金在本报告期末，未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023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 | 4,718.01 |
| 其中：交易所市场 | 4,718.01 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 22,427.44 |
| 合计 | 27,145.45 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|------|-------------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 26,995,620.16 | 26,995,620.16 |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 本期申购 | 309,974.06 | 309,974.06 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,618,625.26 | -2,618,625.26 |
| 本期末 | 24,686,968.96 | 24,686,968.96 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金在本报告期末，未产生其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初 | 7,135,961.30 | -8,095,142.66 | -959,181.36 |
| 本期利润 | -1,400,777.43 | -107,846.76 | -1,508,624.19 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -545,986.56 | 691,578.06 | 145,591.50 |
| 其中：基金申购款 | 80,398.52 | -81,085.28 | -686.76 |
| 基金赎回款 | -626,385.08 | 772,663.34 | 146,278.26 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 5,189,197.31 | -7,511,411.36 | -2,322,214.05 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 7,330.25 |
| 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 | 97.34 |
| 其他 | 24.53 |
| 合计 | 7,452.12 |

6.4.7.14 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 4,033,018.69 |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,293,025.94 |
| 减：交易费用 | 10,749.29 |
| 买卖股票差价收入 | -270,756.54 |

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 卖出/赎回基金成交总额 | 7,397,289.52 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 8,338,688.75 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | - |
| 减：交易费用 | 7,557.22 |
| 基金投资收益 | -948,956.45 |

6.4.7.16 债券投资收益**6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成**

本基金在本报告期内，未持有债券。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金在本报告期内，未持有债券。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内，未持有债券。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内，未持有债券。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益**6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金在本报告期内，未持有资产支持证券。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金在本报告期内，未持有资产支持证券。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内，未持有资产支持证券。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内，未持有资产支持证券。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期内，未持有贵金属。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内，未持有贵金属。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内，未持有贵金属。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内，未持有贵金属。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内，未持有衍生工具。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内，未持有其他衍生工具。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|----|-------------------------------|
|----|-------------------------------|

| | |
|---------------|----------|
| 股票投资产生的股利收益 | 7,557.92 |
| 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 | 7,557.92 |

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -107,846.76 |
| ——股票投资 | 53,705.19 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | -161,551.95 |
| ——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 | -107,846.76 |

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 244.03 |
| 合计 | 244.03 |

6.4.7.23 持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 |
|----------------------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023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） | 96,361.11 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 16,803.97 |

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。

6.4.7.24 信用减值损失

本基金在本报告期内，未产生信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 审计费用 | 17,927.44 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 1,019.43 |
| 其他 | 25,000.00 |
| 合计 | 43,946.87 |

注：其他为公证费和律师费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------|---------------------|
| 浙江浙商证券资产管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 浙商证券股份有限公司 | 基金管理人的母公司、本基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 基金托管人、本基金销售机构 |

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | 上年度可比期间 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 | 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 | 4,329,617.68 | 51.91% | 7,122,583.00 | 77.73% |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | 上年度可比期间 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 | 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 | - | - | 3,002,676.00 | 100.00% |

注：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。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | 上年度可比期间 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 | 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 | 9,832,872.40 | 91.41% | 28,320,811.50 | 96.94% |

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 | 本期 |
|------|----|
| | |

| 称 | 2023年01月01日至2023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 | 3,166.40 | 52.25% | 724.46 | 15.36% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 | 5,208.86 | 78.01% | 2,580.51 | 13.62% |

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、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等。

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 2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间 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 | 126,976.40 | 195,270.02 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 63,070.67 | 93,437.99 |

注：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管理费。支付基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金管理人管理的其他基金公允价值后的余额（若为负数，则取0）1.00%

的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值扣除前一日所持有的本基金管理人管理的其他基金公允价值后的余额×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023 年06月30日 | 上年度可比期间 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 | 25,395.24 | 36,955.26 |

注：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。支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金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托管的其他基金公允价值后的余额（若为负数，则取0）0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金托管人托管的其他基金公允价值后的余额×0.20%/当年天数。

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

本基金在本报告期及上年度可比期间内，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。

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

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未持有本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金在本报告期末及上年度末，未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2023年01月01日至2023年06月30日 | | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|--------------|-------------------------------|----------|------------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 1,627,217.50 | 7,330.25 | 2,845,255.39 | 9,271.95 |

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生其他关联交易事项。

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

本报告期及上年度可比期间，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

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（2023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2023年06月30日止，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023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

本基金在本报告期末，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、流动性风险及市场风险、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

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 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 2023 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 | 1,627,217.50 | - | - | - | - | - | 1,627,217.50 |
| 结算备付金 | 7,493.03 | - | - | - | - | - | 7,493.03 |
| 存出保证金 | 1,996.33 | - | - | - | - | - | 1,996.33 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 20,753,153.40 | 20,753,153.40 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 31,982.69 | 31,982.69 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 39.97 | 39.97 |
| 资产总计 | 1,636,706.86 | - | - | - | - | 20,785,176.06 | 22,421,882.92 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 7,882.17 | 7,882.17 |
| 应付管 | - | - | - | - | - | 18,416.99 | 18,416.99 |

| | | | | | | | |
|--------------------------------|--------------|--------|----------|-------|-------|---------------|---------------|
| 理人报酬 | | | | | | | |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 3,683.40 | 3,683.40 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 27,145.45 | 27,145.45 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 57,128.01 | 57,128.01 |
| 利率敏感度缺口 | 1,636,706.86 | - | - | - | - | 20,728,048.05 | 22,364,754.91 |
| 上年度末 2022 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 | 2,824,726.34 | - | - | - | - | - | 2,824,726.34 |
| 结算备付金 | 19,602.01 | - | - | - | - | - | 19,602.01 |
| 存出保证金 | 4,619.65 | - | - | - | - | - | 4,619.65 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 23,448,409.53 | 23,448,409.53 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 9.99 | 9.99 |
| 资产总计 | 2,848,948.00 | - | - | - | - | 23,448,419.52 | 26,297,367.52 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 95,487.96 | 95,487.96 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 22,457.53 | 22,457.53 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 4,491.52 | 4,491.52 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 138,491.71 | 138,491.71 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 260,928.72 | 260,928.72 |
| 利率敏感度缺口 | 2,848,948.00 | - | - | - | - | 23,187,490.80 | 26,036,438.80 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 | | 上年度末 2022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 | 1,781,570.68 | 7.97 | 1,712,808.00 | 6.58 |
| 交易性金融资产—基金投资 | 18,971,582.72 | 84.83 | 21,735,601.53 | 83.48 |
| 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 | 20,753,153.40 | 92.79 | 23,448,409.53 | 90.06 |
|----|---------------|-------|---------------|-------|

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和基金持仓资产在过去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 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 1、沪深300指数上涨5% | 965,484.40 | 1,196,252.60 |
| | 2、沪深300指数下跌5% | -965,484.40 | -1,196,252.60 |

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 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 风险价值 | -293,405.41 | -507,560.76 |
| | 合计 | -293,405.41 | -507,560.76 |

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：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；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | 20,753,153.40 | 23,448,409.53 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 20,753,153.40 | 23,448,409.53 |

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

本基金本报告期末未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 | 1,781,570.68 | 7.95 |
| | 其中：股票 | 1,781,570.68 | 7.95 |
| 2 | 基金投资 | 18,971,582.72 | 84.61 |
| 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 | 1,634,710.53 | 7.29 |
| 8 | 其他各项资产 | 34,018.99 | 0.15 |
| 9 | 合计 | 22,421,882.92 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 610,972.00 | 2.73 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 933,830.00 | 4.18 |
| 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 | - | - |
| K | 房地产业 | 149,968.00 | 0.67 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 86,800.68 | 0.39 |
| 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 | 1,781,570.68 | 7.97 |

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 | 601186 | 中国铁建 | 53,500 | 526,975.00 | 2.36 |
| 2 | 603225 | 新凤鸣 | 26,700 | 295,035.00 | 1.32 |
| 3 | 002051 | 中工国际 | 24,700 | 294,671.00 | 1.32 |
| 4 | 600383 | 金地集团 | 20,800 | 149,968.00 | 0.67 |
| 5 | 601390 | XD中国中 | 14,800 | 112,184.00 | 0.50 |
| 6 | 300223 | 北京君正 | 1,200 | 105,972.00 | 0.47 |
| 7 | 688334 | 西高院 | 4,833 | 86,800.68 | 0.39 |
| 8 | 688361 | 中科飞测 | 1,000 | 83,010.00 | 0.37 |
| 9 | 603061 | 金海通 | 700 | 82,915.00 | 0.37 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 10 | 600230 | XD沧州大 | 3,000 | 44,040.00 | 0.20 |
|----|--------|-------|-------|-----------|------|

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 | 601186 | 中国铁建 | 795,328.00 | 3.05 |
| 2 | 002049 | 紫光国微 | 504,970.00 | 1.94 |
| 3 | 603225 | 新凤鸣 | 387,513.00 | 1.49 |
| 4 | 002051 | 中工国际 | 295,882.00 | 1.14 |
| 5 | 600383 | 金地集团 | 295,528.00 | 1.14 |
| 6 | 002978 | 安宁股份 | 273,291.00 | 1.05 |
| 7 | 002865 | 钧达股份 | 239,565.00 | 0.92 |
| 8 | 600230 | XD沧州大 | 210,232.00 | 0.81 |
| 9 | 000059 | 华锦股份 | 129,075.00 | 0.50 |
| 10 | 601595 | 上海电影 | 127,073.00 | 0.49 |
| 11 | 601857 | 中国石油 | 125,097.00 | 0.48 |
| 12 | 601390 | XD中国中 | 111,510.00 | 0.43 |
| 13 | 301378 | 通达海 | 110,683.00 | 0.43 |
| 14 | 300113 | 顺网科技 | 110,232.00 | 0.42 |
| 15 | 300223 | 北京君正 | 108,960.00 | 0.42 |
| 16 | 688083 | 中望软件 | 98,190.00 | 0.38 |
| 17 | 603061 | 金海通 | 95,150.00 | 0.37 |
| 18 | 688334 | 西高院 | 90,034.13 | 0.35 |
| 19 | 688361 | 中科飞测 | 77,323.30 | 0.30 |
| 20 | 688576 | 西山科技 | 44,528.00 | 0.17 |

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 | 002049 | 紫光国微 | 524,032.00 | 2.01 |
| 2 | 603688 | 石英股份 | 364,179.00 | 1.40 |
| 3 | 600230 | XD沧州 大 | 303,959.00 | 1.17 |
| 4 | 300724 | 捷佳伟创 | 256,970.00 | 0.99 |
| 5 | 002865 | 钧达股份 | 250,964.00 | 0.96 |
| 6 | 002978 | 安宁股份 | 233,099.00 | 0.90 |
| 7 | 001979 | 招商蛇口 | 232,746.00 | 0.89 |
| 8 | 601186 | 中国铁建 | 221,952.00 | 0.85 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 220,228.00 | 0.85 |
| 10 | 300274 | 阳光电源 | 193,025.00 | 0.74 |
| 11 | 300212 | 易华录 | 138,401.00 | 0.53 |
| 12 | 601595 | 上海电影 | 133,749.00 | 0.51 |
| 13 | 601628 | 中国人寿 | 125,994.00 | 0.48 |
| 14 | 601857 | 中国石油 | 121,877.00 | 0.47 |
| 15 | 300113 | 顺网科技 | 116,550.44 | 0.45 |
| 16 | 000059 | 华锦股份 | 112,799.00 | 0.43 |
| 17 | 301378 | 通达海 | 111,159.00 | 0.43 |
| 18 | 688083 | 中望软件 | 91,220.73 | 0.35 |
| 19 | 600383 | 金地集团 | 89,772.00 | 0.34 |
| 20 | 603225 | 新凤鸣 | 68,208.00 | 0.26 |

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 | 4,308,083.43 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,033,018.69 |

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持有贵金属。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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） | 占基金资产净值比例(%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| 1 | 519714 | 交银消费新驱动股票 | 契约型 开放式 | 2,000,000.00 | 3,572,000.00 | 15.97 | 否 |
| 2 | 512690 | 酒ETF | 交易型 开放式 | 3,098,900.00 | 2,367,559.60 | 10.59 | 否 |
| 3 | 515030 | 新汽车 | 交易型 开放式 | 1,373,500.00 | 2,113,816.50 | 9.45 | 否 |
| 4 | 159996 | 家电ETF | 交易型 开放式 | 1,634,700.00 | 1,909,329.60 | 8.54 | 否 |
| 5 | 000729 | 建信中小盘先锋股票A | 契约型 开放式 | 354,986.99 | 1,281,858.02 | 5.73 | 否 |
| 6 | 001717 | 工银前沿医疗股票A | 契约型 开放式 | 330,000.00 | 1,134,870.00 | 5.07 | 否 |
| 7 | 540008 | 汇丰晋信低碳先锋股票A | 契约型 开放式 | 340,468.40 | 1,083,949.25 | 4.85 | 否 |
| 8 | 005235 | 银华食品饮料 | 契约型 | 482,731.27 | 1,007,267. | 4.50 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|---------------------|------------|------------------|------------|------|---|
| | | 量化股票发起 式A | 开放式 | | 07 | | |
| 9 | 512400 | 有色ETF | 交易型 开放式 | 891,500.00 | 921,811.00 | 4.12 | 否 |
| 10 | 159745 | 国泰中证全指 建筑材料ETF | 交易型 开放式 | 1,200,700. 00 | 841,690.70 | 3.76 | 否 |
| 11 | 515790 | 光伏ETF | 交易型 开放式 | 505,700.00 | 628,585.10 | 2.81 | 否 |
| 12 | 009891 | 融通产业趋势 臻选股票A | 契约型 开放式 | 440,295.55 | 507,528.68 | 2.27 | 否 |
| 13 | 159928 | 消费ETF | 交易型 开放式 | 487,800.00 | 451,702.80 | 2.02 | 否 |
| 14 | 516110 | 汽车ETF | 交易型 开放式 | 321,300.00 | 336,079.80 | 1.50 | 否 |
| 15 | 516150 | 稀土基金 | 交易型 开放式 | 233,500.00 | 261,520.00 | 1.17 | 否 |
| 16 | 159883 | 永赢中证全指 医疗器械ETF | 交易型 开放式 | 401,600.00 | 243,369.60 | 1.09 | 否 |
| 17 | 512010 | 易方达沪深300 医药卫生ETF | 交易型 开放式 | 564,400.00 | 239,870.00 | 1.07 | 否 |
| 18 | 515880 | 通信ETF | 交易型 开放式 | 52,500.00 | 68,775.00 | 0.31 | 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 | 1,996.33 |
| 2 | 应收清算款 | 31,982.69 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 39.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 34,018.99 |

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

| 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 |
| 434 | 56,882.42 | 9.72 | 0.00% | 24,686,959.24 | 100.00% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 48,000.73 | 0.1944% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

注：

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人本报告期末未持有本基金；
- 2、本基金的基金经理本报告期末未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2020年05月15日)基金份额总额 | 292,519,181.91 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 26,995,620.16 |
| 本报告期基金总申购份额 | 309,974.06 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,618,625.26 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 24,686,968.96 |

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，公司已向中国证监会报告并以通讯方式召开了基金份额持有人大会。会议投票表决起止时间自2023年5月13日起至2023年6月8日17:00止。本次会议未达到法定召开条件，会议详情请见2023年6月10日在规定媒介发布的《浙江浙商证券资产管理有限公司关于浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会会议情况的公告》。

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

2023年6月，浙江浙商证券资产管理有限公司聘任陈国辉先生担任副总经理职务；聘任石磊女士担任副总经理职务；聘任黄玉锋先生担任首席信息官职务。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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 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

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未涉及托管人及其高级管理人员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 | |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴 | 1 | 4,011,484.44 | 48.09% | 2,893.39 | 47.75% | - |

| | | | | | | |
|------|---|--------------|--------|----------|--------|---|
| 证券 | | | | | | |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | 4,329,617.68 | 51.91% | 3,166.40 | 52.25% | - |

注：a)截至报告期末，本公司已在深圳交易所、上海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。

10.8.2 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 |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - | 924,458.10 | 8.59% |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|--------------|--------|
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - | 9,832,872.40 | 91.41% |
|------|---|---|---|---|---|---|--------------|--------|

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 | 浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）2022年第四季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-20 |
| 2 | 浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-02-14 |
| 3 | 关于浙江浙商证券资产管理有限公司旗下部分基金参与深圳新华信通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 | 2023-03-29 |
| 4 | 浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）2022年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-30 |
| 5 | 浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）2023年第1季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-21 |
| 6 | 关于浙江浙商证券资产管理有限公司旗下部分基金参与北京新浪仓石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 | 2023-04-24 |
| 7 | 浙江浙商证券资产管理有限公司关于浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-10 |
| 8 | 浙江浙商证券资产管理有限公司 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-11 |

| | | | |
|----|--|-----------|------------|
| | 公司关于浙商汇金卓越优选 3 个月持有期股票型基金中基金（FOF）以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告 | | |
| 9 | 浙商汇金卓越优选 3 个月持有期股票型基金中基金（FOF）招募说明书（更新）（2023 年定期更新） | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-12 |
| 10 | 浙商汇金卓越优选 3 个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-12 |
| 11 | 浙江浙商证券资产管理有限公司关于浙商汇金卓越优选 3 个月持有期股票型基金中基金（FOF）以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-12 |
| 12 | 关于浙商汇金卓越优选 3 个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会会议情况的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-10 |
| 13 | 浙江浙商证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-16 |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|--|----------------|--------------------------|--------------|------|------------|--------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 个人 | 1 | 20230101 - 20230630 | 6,500,361.11 | 0.00 | 0.00 | 6,500,361.11 | 26.33% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 报告期内，本基金单一客户持有份额比例超过基金总份额的 20%，除本基金招募说明书中列示的各项风险情形外，还包括因该类投资者巨额赎回可能导致的基金清盘风险、流动性风险和基金净值波动风险。 | | | | | | | |

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内未出现其他影响投资者决策的重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准设立浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）的文件；

《浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金合同》；

《浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（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

二〇二三年八月三十日