

浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券
投资基金
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 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、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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	52

8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
8.6 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	59
8.7 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	59
8.8 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	59
8.9 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	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 本报告期投资基金情况	60
8.13 投资组合报告附注	60
§ 9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.3 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	61
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	62
§ 10 开放式基金份额变动	62
§ 11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
11.2 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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	63
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.9 其他重大事件	66
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	67
12.1 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	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
13.2 存放地点	68
13.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	浙商大数据智选消费	
基金主代码	002967	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 1 月 11 日	
基金管理人	浙商基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	150,542,689.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C
下属分级基金的交易代码	002967	014813
报告期末下属分级基金的份额总额	149,621,192.88 份	921,496.54 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过公司自主研发的大数据智选模型进行行业配置和个股选择，在严格控制风险的前提下，力争获取较好的收益。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，在科学分析与有效管理风险的基础上，实现风险与收益的最佳匹配。
业绩比较基准	中证主要消费行业指数×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浙商基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	楼羿南	王小飞
	联系电话	021-60350831	021-60637103
	电子邮箱	louyinan@zsfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	021-60637228
传真		0571-28191919	021-60635778
注册地址		浙江省杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	310012	100033
法定代表人	肖风	张金良

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 2 幢 25 楼
注册登记机构	浙商基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年		2023 年		2022 年	2022 年 3 月 2 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日
	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C
本期已实现收益	-18,783,862.60	-31,301.17	-24,138,288.04	-30,006.00	-106,274,850.99	-75,143.84
本期利润	-17,652,769.43	-5,917.82	-41,859,738.25	-30,462.50	-138,943,005.89	-52,349.83
加权平均基金份额本期利润	-0.1125	-0.0165	-0.2199	-0.1799	-0.6089	-0.3713
本期加权平均净值利润率	-7.06%	-1.05%	-11.58%	-9.67%	-29.18%	-18.81%
本期基金份额净值	-6.09%	-6.82%	-12.28%	-13.01%	-23.44%	-15.34%

增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	60,003,363.39	338,215.08	87,259,189.82	95,860.00	146,115,079.22	166,355.22
期末可供分配基金份额利润	0.4010	0.3670	0.5170	0.4941	0.6641	0.6544
期末基金资产净值	240,013,451.89	1,446,418.74	288,211,419.03	326,905.40	428,470,735.10	492,434.07
期末基金份额净值	1.604	1.570	1.708	1.685	1.947	1.937
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	60.40%	-31.38%	70.80%	-26.35%	94.70%	-15.34%

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

浙商大数据智选消费 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
过去三个月	-4.86%	1.62%	-4.62%	1.16%	-0.24%	0.46%
过去六个月	2.95%	1.59%	4.31%	1.26%	-1.36%	0.33%
过去一年	-6.09%	1.32%	-0.21%	1.02%	-5.88%	0.30%
过去三年	-36.92%	1.22%	-16.82%	0.88%	-20.10%	0.34%
过去五年	8.31%	1.32%	14.33%	0.96%	-6.02%	0.36%
自基金合同生效起至今	60.40%	1.22%	80.81%	0.95%	-20.41%	0.27%

浙商大数据智选消费 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④
----	----------	------------	-----------	--------------	-----	-----

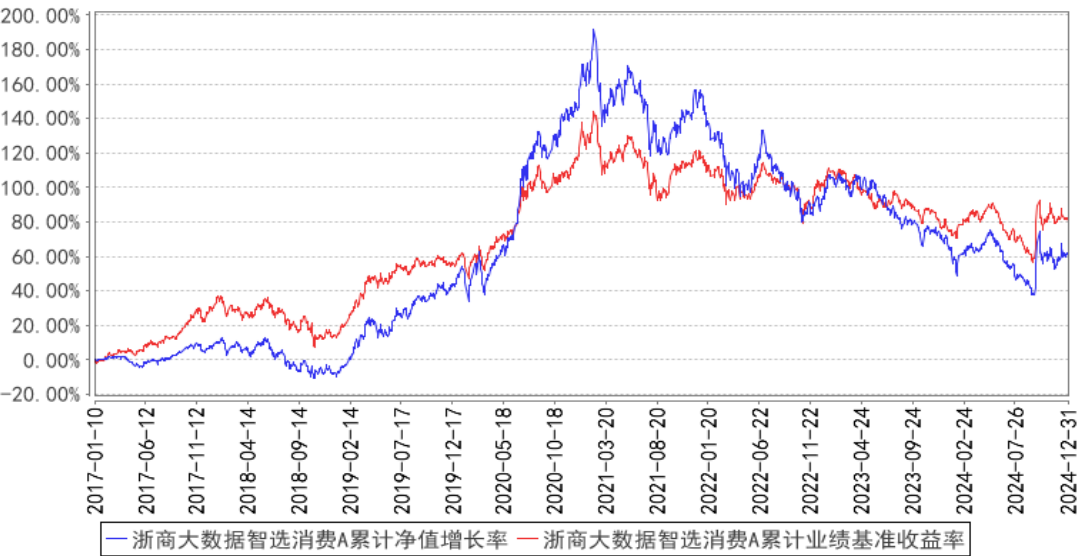
		②	率③	准差④		
过去三个月	-5.08%	1.62%	-4.62%	1.16%	-0.46%	0.46%
过去六个月	2.55%	1.59%	4.31%	1.26%	-1.76%	0.33%
过去一年	-6.82%	1.32%	-0.21%	1.02%	-6.61%	0.30%
自基金合同生效 起至今	-31.38%	1.22%	-14.00%	0.88%	-17.38%	0.34%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证主要消费行业指数×60%+上证国债指数收益率×40%

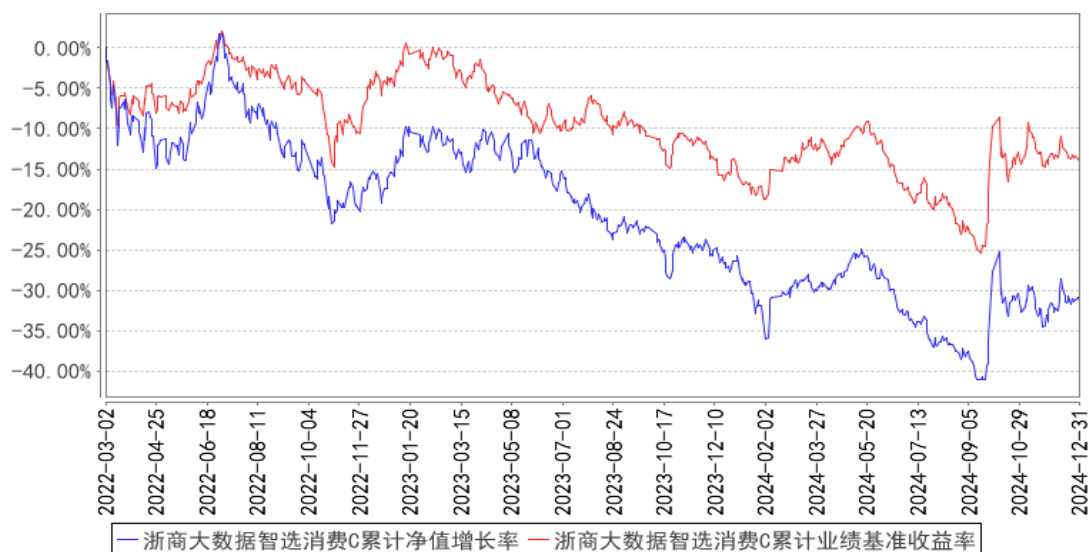
2、本基金于 2022 年 3 月 2 日起新增 C 类份额。

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

浙商大数据智选消费A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浙商大数据智选消费C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



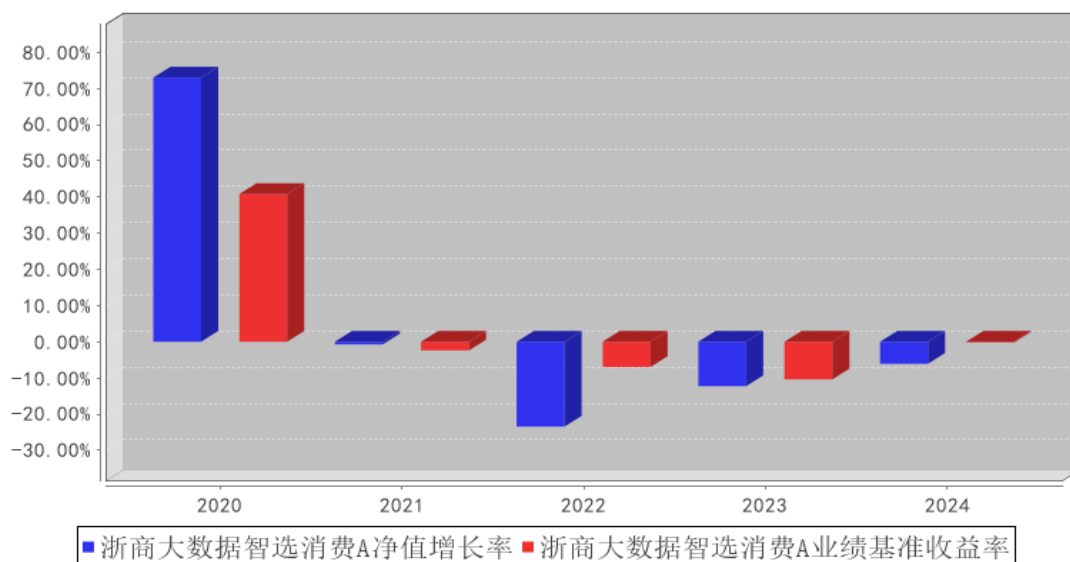
注：1、本基金基金合同生效日为 2017 年 1 月 11 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间已满一年。

2、本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

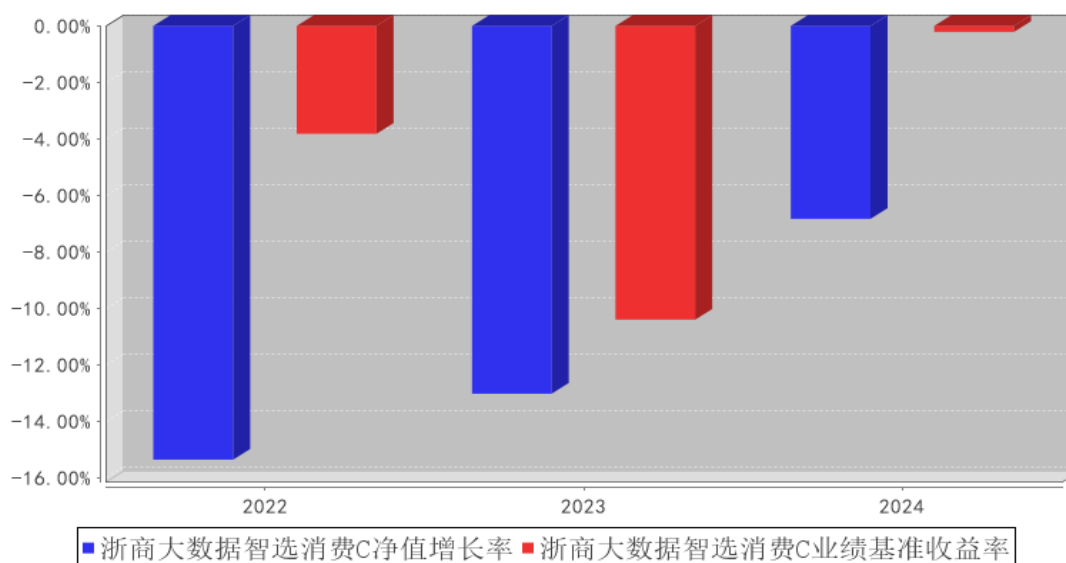
3、本基金自 2022 年 3 月 2 日起增设 C 类份额。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浙商大数据智选消费A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



浙商大数据智选消费C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金自 2022 年 3 月 2 日起增设 C 类份额。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金在过去三年内未进行过利润分配。

§ 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

浙商基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会(证监许可[2010]1312 号)批准,于 2010 年 10 月 21 日成立。公司股东为民生人寿保险股份有限公司、浙商证券股份有限公司、养生堂有限公司。民生人寿保险股份有限公司出资 15000 万元,浙商证券股份有限公司和养生堂有限公司各出资 7500 万元,注册资本 3 亿元人民币。注册地为浙江省杭州市。

截止 2024 年 12 月 31 日,浙商基金共管理三十九只开放式基金——浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、浙商聚盈纯债债券型证券投资基金、浙商日添利货币市场基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、浙商中证 500 指数增强型证券投资基金、浙商惠丰定期开放债券型证券投资基金、浙商惠利纯债债券型证券投资基金、浙商惠裕纯债债券型证券投资基金、浙商惠南纯债债券型证券投资基金、浙商日添金货币市场基金、浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金、浙商全景消费混合型证券投资基金、浙商丰利增强债券型证券投资基金、浙商兴永纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商沪港深精选混合型证券投资基金、浙商智能行业优选混合

型发起式证券投资基金、浙商港股通中华交易服务预期高股息指数增强型证券投资基金、浙商惠泉 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浙商丰顺纯债债券型证券投资基金、浙商惠睿纯债债券型证券投资基金、浙商丰裕纯债债券型证券投资基金、浙商中短债债券型证券投资基金、浙商智多兴稳健回报一年持有期混合型证券投资基金、浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金、浙商智多宝稳健一年持有期混合型证券投资基金、浙商惠隆 39 个月定期开放债券型证券投资基金、浙商智选经济动能混合型证券投资基金、浙商智选价值混合型证券投资基金、浙商智多金稳健一年持有期混合型证券投资基金、浙商智选领航三年持有期混合型证券投资基金、浙商智选先锋一年持有期混合型证券投资基金、浙商智多享稳健混合型发起式证券投资基金、浙商智多盈债券型证券投资基金、浙商兴盈 6 个月定期开放债券型证券投资基金、浙商智配瑞享一年持有期债券型基金中基金（FOF）、浙商智选新兴产业混合型证券投资基金、浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金。

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		
白玉	本基金的基金经理，公司智能权益投资部基金经理	2022 年 1 月 13 日	-	18 年	白玉女士，英国雷丁大学国际证券、投资和银行学硕士，历任北京兴华会计师事务所审计助理、万家基金管理有限公司研究员。

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

注：本报告期本基金不存在基金经理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

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了规范公平交易行为，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律

法规规定，本公司制定了相应的公平交易制度。在投资决策层面，本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，对不同类别的投资组合分别管理、独立决策；在交易层面，实行集中交易制度，建立了公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会，严禁在不同投资组合之间进行利益输送；在监控和评估层面，本公司监察风控部将每日审查当天的投资交易，对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

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

9 月 24 日，A 股市场在央行降准、降息等政策利好的推动下，迎来了久违的大涨。大家对于消费的信心有所回暖，并且随着各地消费品补贴政策的落地带动了 10 月消费的回弹。但是 11 月和 12 月的消费数据整体表现略微放平，一方面是由于基数比较高，另一方面是由于这个消费信心的回暖是逐步的，不是一蹴而就的。因此，市场经历了过山车的行情，消费板块也随之回调。我们发现许多优秀公司的估值已经非常便宜，此外，消费板块虽然承压，但并非完全没有亮点。首先，美护板块，重组胶原蛋白细分赛道的个别公司表现出色。外资品牌和传统老品牌的市场份额有所下滑，而那些主动求变、策略灵活、对消费者需求有深刻洞察的新型品牌，通过抓住短视频媒介类新兴平台，实现了快速增长，其产品力和品牌力也在逐步提升。

宠物赛道同样不容忽视，宠物食品中的主粮板块展现出较强的韧性和亮眼表现，同时保健品和宠物用品等细分市场的营收增长迅速。国货品牌不仅在国内市场上具备出海和自主品牌替代的潜力，也在国际市场上展现出竞争力。

家电以旧换新以及消费券等进一步提高消费者信心，提高整个全社会边际消费倾向。

新能源汽车行业作为全球汽车产业转型的关键方向，展现出巨大的市场潜力和投资价值。

因此，我们在调整中逢低布局了一些具有良好现金流，估值便宜的个股，也买入了一些市场

空间大，成长性高的细分赛道龙头。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，浙商大数据智选消费混合 A 基金份额净值为 1.604 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.09%；截至本报告期末浙商大数据智选消费混合 C 基金份额净值为 1.570 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.82%；同期业绩比较基准收益率为-0.21%。

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 2025 年，若美联储加息周期结束，全球流动性压力缓解，消费信心有望逐步恢复，中国在稳增长政策下，内需或成为核心引擎。

我们认为，随着货币政策和财政政策的持续发力，社融和通缩状况有望得到改善。2024 金融街论坛年会上强调，将进一步健全货币政策框架，并将促进物价合理回升作为重要目标。这样的宏观背景为消费板块的投资机会创造了有利条件。

对于出口市场，尽管特朗普上台后对华关税政策尚有不确定性，但从长期角度来看，全球产业链的重塑为具备出海能力的制造企业带来了新的机遇。人民币的持续贬值和国内利率的下降有助于降低这些企业海外投资的成本，提升其国际竞争力。同时，“一带一路”倡议所覆盖的亚洲、非洲和拉丁美洲国家和地区，作为中国推动的全球化新路径，为中国企业提供了广阔的市场和投资机会。

因此，2025 年我们看好出海链上的优秀公司包括家电、家居、汽车、纺服等，也看好内需消费中提供更多情绪价值的宠物消费，以及具备刚需属性的大众食品等。

此外，今年我们也看好创新药及产业链的投资机会。近期随着中国互联网资产重估的趋势，在生物医药研发领域，中国正日益成为公认的创新来源，在更广泛的治疗模式，如 ADC、双抗、TCE 等领域获得了全球认可，中国生物科技领域的全球化机遇也在被发掘。预计在 2025-2026 年，随着运营效率的提高、强劲的销售增长和严格的支出控制，部分领先的生物科技公司将实现盈亏平衡。这个板块已经连续下跌三年，估值已处于历史低位，其中对外合作可见度高，管线价值优越的资产有望率先底部反转。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人监察稽核工作重点是加强基金投资交易的风险控制，保证本基金投资运作的合法合规性。通过加大日常业务检查力度，对公司投研、营销、运作等业务进行专项检查，开展员工行为合规检查，进行投资研究、销售等业务的合规培训，来增强员工合规意识，促进公司业务的合规运作。

报告期内，本基金管理人管理的基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人利益。本基金

管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作的估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 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

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

§ 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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、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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2500207 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	该基金管理人浙商基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注

任	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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张楠	朱鹏飞
会计师事务所的地址	上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 2 幢 25 楼	
审计报告日期	2025 年 03 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	28,170,194.82	76,830,548.35
结算备付金		964,595.11	317,690.91
存出保证金		143,922.04	145,755.47
交易性金融资产	7.4.7.2	213,249,316.43	211,907,160.70
其中：股票投资		213,249,316.43	211,907,160.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		121,933.36	149,262.52
应收股利		-	-
应收申购款		34,677.25	66,843.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		242,684,639.01	289,417,261.90
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		450,214.60	113,635.42

应付管理人报酬		247,755.36	296,920.09
应付托管费		41,292.54	49,486.69
应付销售服务费		970.23	224.42
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	7.4.7.9	484,535.65	418,670.85
负债合计		1,224,768.38	878,937.47
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	150,542,689.42	168,959,400.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	90,917,181.21	119,578,924.43
净资产合计		241,459,870.63	288,538,324.43
负债和净资产总计		242,684,639.01	289,417,261.90

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，浙商大数据智选消费 A 份额净值 1.6040 元，基金份额总额 149,621,192.88 份，浙商大数据智选消费 C 份额净值 1.5700 元，基金份额总额 921,496.54 份，总份额合计 150,542,689.42 份。

7.2 利润表

会计主体：浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-13,951,317.58	-35,796,378.31
1. 利息收入		212,984.54	255,542.78
其中：存款利息收入	7.4.7.13	198,735.23	224,200.32
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		14,249.31	31,342.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-15,345,013.59	-18,400,037.50
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-21,946,866.24	-21,990,345.19
基金投资收益	7.4.7.15	-	-
债券投资收益	7.4.7.16	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.17	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	6,601,852.65	3,590,307.69
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）	7.4.7.21	1,156,476.52	-17,721,906.71
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.22	24,234.95	70,023.12
减：二、营业总支出		3,707,369.67	6,093,822.44
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,009,911.28	5,056,764.61
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	501,651.84	842,794.07
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	4,396.39	2,545.02
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	7.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.25	191,410.16	191,718.74
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-17,658,687.25	-41,890,200.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-17,658,687.25	-41,890,200.75
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-17,658,687.25	-41,890,200.75

7.3 净资产变动表

会计主体：浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	168,959,400.00	-	119,578,924.43	288,538,324.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	168,959,400.00	-	119,578,924.43	288,538,324.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,416,710.58	-	-28,661,743.22	-47,078,453.80
（一）、综合收益总额	-	-	-17,658,687.25	-17,658,687.25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-18,416,710.58	-	-11,003,055.97	-29,419,766.55
其中：1. 基金申购款	15,203,761.48	-	9,098,318.21	24,302,079.69
2. 基金赎回款	-33,620,472.06	-	-20,101,374.18	-53,721,846.24
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	150,542,689.42	-	90,917,181.21	241,459,870.63
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	220,265,136.99	-	208,698,032.18	428,963,169.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	220,265,136.99	-	208,698,032.18	428,963,169.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-51,305,736.99	-	-89,119,107.75	-140,424,844.74
(一)、综合收益总额	-	-	-41,890,200.75	-41,890,200.75
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-51,305,736.99	-	-47,228,907.00	-98,534,643.99
其中：1. 基金申购款	16,851,115.60	-	15,491,959.78	32,343,075.38
2. 基金赎回款	-68,156,852.59	-	-62,720,866.78	-130,877,719.37
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	168,959,400.00	-	119,578,924.43	288,538,324.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘岩

鞠海洋

周志

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资

资基金注册的批复》（证监许可〔2016〕1283号）批准，由浙商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2017年1月11日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为488,689,300.96份基金份额。本基金的基金管理人为浙商基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0-95%，投资于消费主题的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证主要消费行业指数 $\times$ 60%+上证国债指数收益率 $\times$ 40%。

7.4.2 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》（以下合称“企业会计准则”）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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 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及附注7.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2024年12月31日的财务状况、2024年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、衍生工具和买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合

同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

-以摊余成本计量的金融资产

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

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利

得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损

失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类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；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告〔2017〕13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6 号《关于

发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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》、财税[2017]2号文《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》、财税

[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	28,170,194.82	76,830,548.35
等于：本金	28,167,295.99	76,822,938.87
加：应计利息	2,898.83	7,609.48

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	28,170,194.82	76,830,548.35

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		210,066,148.16	-	213,249,316.43	3,183,168.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		210,066,148.16	-	213,249,316.43	3,183,168.27
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		209,880,468.95	-	211,907,160.70	2,026,691.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	209,880,468.95	-	211,907,160.70	2,026,691.75
----	----------------	---	----------------	--------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金于本报告期及上年度末均无债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金于本报告期及上年度末均无其他债权投资减值准备。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	186.92	100.60
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	314,348.73	248,570.25
其中：交易所市场	314,348.73	248,570.25
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费	50,000.00	50,000.00
合计	484,535.65	418,670.85

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

浙商大数据智选消费 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	168,765,378.07	168,765,378.07
本期申购	14,204,211.42	14,204,211.42
本期赎回（以“-”号填列）	-33,348,396.61	-33,348,396.61
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	149,621,192.88	149,621,192.88

浙商大数据智选消费 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	194,021.93	194,021.93
本期申购	999,550.06	999,550.06
本期赎回（以“-”号填列）	-272,075.45	-272,075.45
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	921,496.54	921,496.54

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

浙商大数据智选消费 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	87,259,189.82	32,186,851.14	119,446,040.96
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	87,259,189.82	32,186,851.14	119,446,040.96
本期利润	-18,783,862.60	1,131,093.17	-17,652,769.43
本期基金份额交易产生的变动数	-8,471,963.83	-2,929,048.69	-11,401,012.52
其中：基金申购款	5,993,326.55	2,551,960.67	8,545,287.22
基金赎回款	-14,465,290.38	-5,481,009.36	-19,946,299.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,003,363.39	30,388,895.62	90,392,259.01

浙商大数据智选消费 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	95,860.00	37,023.47	132,883.47
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	95,860.00	37,023.47	132,883.47
本期利润	-31,301.17	25,383.35	-5,917.82
本期基金份额交易产生的变动数	273,656.25	124,300.30	397,956.55
其中：基金申购款	384,124.69	168,906.30	553,030.99
基金赎回款	-110,468.44	-44,606.00	-155,074.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	338,215.08	186,707.12	524,922.20

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	187,329.11	211,285.70
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	9,757.32	10,444.31
其他	1,648.80	2,470.31
合计	198,735.23	224,200.32

注：其他列示的是结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-21,946,866.24	-21,990,345.19
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-21,946,866.24	-21,990,345.19

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	905,923,206.43	1,030,124,589.07
减：卖出股票成本总额	926,220,319.51	1,049,364,417.51
减：交易费用	1,649,753.16	2,750,516.75
买卖股票差价收入	-21,946,866.24	-21,990,345.19

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.15 基金投资收益

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-买卖债券差价收入。

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,601,852.65	3,590,307.69
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	6,601,852.65	3,590,307.69

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,156,476.52	-17,721,906.71
股票投资	1,156,476.52	-17,721,906.71
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	1,156,476.52	-17,721,906.71

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	24,215.26	70,005.61
基金转换费收入	19.69	17.51
合计	24,234.95	70,023.12

7.4.7.23 持有基金产生的费用

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无持有基金产生的费用。

7.4.7.24 信用减值损失

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	3,410.16	3,718.74
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	191,410.16	191,718.74

7.4.7.26 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

浙商基金管理有限公司（“浙商基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
浙商证券股份有限公司（“浙商证券”）	基金管理人的股东
民生人寿保险股份有限公司（“民生人寿”）	基金管理人的股东
养生堂有限公司	基金管理人的股东
上海聚潮资产管理有限公司（“聚潮资管”）	基金管理人的子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,009,911.28	5,056,764.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,462,975.09	2,264,609.06
应支付基金管理人的净管理费	1,546,936.19	2,792,155.55

注：支付基金管理人浙商基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.20%的年费率

计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	501,651.84	842,794.07

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 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×0.20%/当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C	合计
浙商基金	-	1,774.54	1,774.54
合计	-	1,774.54	1,774.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C	合计
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 × 0.80%/ 当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C
基金合同生效日（ 2017 年 1 月 11 日）持有的基金份额	-	0.00
报告期初持有的基金份额	-	0.00
报告期间申购/买入总份额	-	700,720.37
报告期间因拆分变动份额	-	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额	-	700,720.37
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.4655%
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C
基金合同生效日（ 2017 年 1 月 11 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

7.4.10.5.2 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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	28,170,194.82	187,329.11	76,830,548.35	211,285.70

注：本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2024 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 964,595.11 元。（2023 年 12 月 31 日：人民币 317,690.91 元）

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

7.4.10.8.2 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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001391	国货航	2024 年	6 个月	新股锁	2.30	6.80	1,773	4,077.90	12,056.40	-

		12月23日		定							
301522	上大股份	2024年10月9日	6个月	新股锁定	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44		-
301552	科力装备	2024年7月15日	6个月	新股锁定	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41		-
301556	托普云农	2024年10月10日	6个月	新股锁定	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35		-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	6个月	新股锁定	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50		-
301603	乔锋智能	2024年7月3日	6个月	新股锁定	26.50	41.98	228	6,042.00	9,571.44		-
301606	绿联科技	2024年7月17日	6个月	新股锁定	21.21	36.49	308	6,532.68	11,238.92		-
301617	博苑股份	2024年12月3日	6个月	新股锁定	27.76	39.79	220	6,107.20	8,753.80		-
301622	英思特	2024年11月26日	6个月	新股锁定	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52		-
301626	苏州天脉	2024年10月17日	6个月	新股锁定	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46		-
301631	壹连科技	2024年11月12日	6个月	新股锁定	72.99	101.96	95	6,934.05	9,686.20		-
603072	天和磁材	2024年12月24日	1个月内(含)	新股未上市	12.30	12.30	1,683	20,700.90	20,700.90		-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股未上市并锁定	12.30	12.30	188	2,312.40	2,312.40		-
603091	众鑫股份	2024年9月10日	6个月	新股锁定	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42		-
603207	小方制药	2024年8月19日	6个月	新股锁定	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25		-
603285	键邦股	2024年	6个月	新股锁	18.65	22.61	124	2,312.60	2,803.64		-

	份	6 月 28 日		定						
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定	17.39	17.95	131	2,278.09	2,351.45	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股锁定	11.25	29.44	949	10,676.25	27,938.56	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁定	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定	55.18	165.78	149	8,221.82	24,701.22	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股锁定	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股锁定	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股锁定	17.58	33.06	874	15,364.92	28,894.44	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。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。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、监察风控部、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

7.4.13.2 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同责任，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建设银行，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，本基金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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有短期债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有长期债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 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严格按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金 7 日可变现资产始终保持较高水平，基金资产整体具备良好流动性。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

下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负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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							
货币资金	28,170,194.82	-	-	-	-	-	28,170,194.82
结算备付金	964,595.11	-	-	-	-	-	964,595.11
存出保证金	143,922.04	-	-	-	-	-	143,922.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-	213,249,316.43	213,249,316.43
应收申购款	-	-	-	-	-	34,677.25	34,677.25
应收清算款	-	-	-	-	-	121,933.36	121,933.36
资产总计	29,278,711.97	-	-	-	-	213,405,927.04	242,684,639.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	450,214.60	450,214.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	247,755.36	247,755.36
应付托管费	-	-	-	-	-	41,292.54	41,292.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-	970.23	970.23
其他负债	-	-	-	-	-	484,535.65	484,535.65
负债总计	-	-	-	-	-	1,224,768.38	1,224,768.38
利率敏感度缺口	29,278,711.97	-	-	-	-	-212,181,158.66	241,459,870.63

上年度末 2023 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							
货币资金	76,830,548.35	-	-	-	-	-	76,830,548.35
结算备付金	317,690.91	-	-	-	-	-	317,690.91
存出保证金	145,755.47	-	-	-	-	-	145,755.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	211,907,160.70	211,907,160.70
应收申购款	-	-	-	-	-	66,843.95	66,843.95
应收清算款	-	-	-	-	-	149,262.52	149,262.52
资产总计	77,293,994.73	-	-	-	-	212,123,267.17	289,417,261.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	113,635.42	113,635.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	296,920.09	296,920.09
应付托管费	-	-	-	-	-	49,486.69	49,486.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	224.42	224.42
其他负债	-	-	-	-	-	418,670.85	418,670.85
负债总计	-	-	-	-	-	878,937.47	878,937.47
利率敏感度缺口	77,293,994.73	-	-	-	-	-211,244,329.70	288,538,324.43

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本年末及上年末，本基金均未持有对利率有敏感性的债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

7.4.13.4.2 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，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，在科学分析与有效管理信用风险的基础上，实现风险与收益的最佳匹配。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023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	213,249,316.43	88.32	211,907,160.70	73.44
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	213,249,316.43	88.32	211,907,160.70	73.44

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除敏感性分析基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	10,417,050.12	8,170,191.64
	沪深 300 指数下降 5%	-10,417,050.12	-8,170,191.64

注：本基金以沪深 300 指数作为其他价格波动风险的敏感性分析基准。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	212,880,025.06	211,292,730.22
第二层次	23,013.30	-
第三层次	346,278.07	614,430.48
合计	213,249,316.43	211,907,160.70

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。 对于证券交易所上市的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关金融工具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，确定相关金融工具公允价值应属第二层次还是第三层次。
--

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	614,430.48	614,430.48
当期购买	-	141,378.35	141,378.35
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	614,430.48	614,430.48
当期利得或损失总额	-	204,899.72	204,899.72
其中：计入损益的利得或损失	-	204,899.72	204,899.72
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	346,278.07	346,278.07
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	204,899.72	204,899.72
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	963,099.94	963,099.94
当期购买	-	538,232.71	538,232.71
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	963,099.94	963,099.94
当期利得或损失总额	-	76,197.77	76,197.77
其中：计入损益的利得或损失	-	76,197.77	76,197.77
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	614,430.48	614,430.48
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	76,197.77	76,197.77

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允	采用的估值	不可观察输入值
----	-------	-------	---------

	价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	346,278.07	亚式期权模型	预期波动率	34.23%-470.81%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	614,430.48	亚式期权模型	预期波动率	14.62%-217.75%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日：无)。

7.4.14.4 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 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，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	213,249,316.43	87.87
	其中：股票	213,249,316.43	87.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	29,134,789.93	12.01

8	其他各项资产	300,532.65	0.12
9	合计	242,684,639.01	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	703,326.00	0.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	165,156,778.55	68.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,563.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,658,732.10	7.73
G	交通运输、仓储和邮政业	12,056.40	0.00
H	住宿和餐饮业	2,087.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,202,262.13	0.91
J	金融业	12,182.69	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,042,069.00	4.99
M	科学研究和技术服务业	681,767.56	0.28
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	13,776,492.00	5.71
S	综合	-	-
	合计	213,249,316.43	88.32

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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	301498	乖宝宠物	169,800	13,298,736.00	5.51
2	002311	海大集团	257,300	12,620,565.00	5.23
3	600887	伊利股份	368,800	11,130,384.00	4.61

4	000333	美的集团	128,900	9,695,858.00	4.02
5	002891	中宠股份	223,200	7,968,240.00	3.30
6	002946	新乳业	515,700	7,482,807.00	3.10
7	600298	安琪酵母	192,300	6,932,415.00	2.87
8	300119	瑞普生物	374,800	6,885,076.00	2.85
9	603345	安井食品	82,800	6,746,544.00	2.79
10	000568	泸州老窖	51,229	6,413,870.80	2.66
11	300783	三只松鼠	172,600	6,363,762.00	2.64
12	000858	五粮液	44,657	6,253,766.28	2.59
13	300662	科锐国际	295,900	6,231,654.00	2.58
14	600872	中炬高新	262,000	5,769,240.00	2.39
15	600415	小商品城	427,700	5,735,457.00	2.38
16	600690	海尔智家	200,033	5,694,939.51	2.36
17	002847	盐津铺子	89,940	5,630,244.00	2.33
18	000729	燕京啤酒	431,800	5,198,872.00	2.15
19	000423	东阿阿胶	80,156	5,027,384.32	2.08
20	000895	双汇发展	192,400	4,994,704.00	2.07
21	600519	贵州茅台	3,130	4,770,120.00	1.98
22	600809	山西汾酒	25,574	4,710,986.54	1.95
23	600827	百联股份	419,500	4,585,135.00	1.90
24	002371	北方华创	11,500	4,496,500.00	1.86
25	300673	佩蒂股份	237,400	4,209,102.00	1.74
26	002956	西麦食品	235,280	3,922,117.60	1.62
27	003006	百亚股份	140,900	3,380,191.00	1.40
28	601928	凤凰传媒	246,700	2,846,918.00	1.18
29	600694	大商股份	98,430	2,595,599.10	1.07
30	600757	长江传媒	267,700	2,561,889.00	1.06
31	601098	中南传媒	165,800	2,488,658.00	1.03
32	000417	合百集团	389,800	2,486,924.00	1.03
33	603288	海天味业	53,559	2,458,358.10	1.02
34	603193	润本股份	103,600	2,419,060.00	1.00
35	601019	山东出版	210,800	2,392,580.00	0.99
36	600729	重庆百货	81,100	2,372,175.00	0.98
37	000719	中原传媒	199,300	2,264,048.00	0.94
38	002557	洽洽食品	77,599	2,254,250.95	0.93
39	300413	芒果超媒	79,200	2,129,688.00	0.88
40	003000	劲仔食品	94,000	1,287,800.00	0.53
41	002475	立讯精密	30,300	1,235,028.00	0.51
42	601900	南方传媒	80,900	1,222,399.00	0.51
43	002563	森马服饰	171,000	1,200,420.00	0.50
44	300498	温氏股份	42,600	703,326.00	0.29
45	300347	泰格医药	9,800	535,276.00	0.22
46	002327	富安娜	40,300	356,252.00	0.15

47	000538	云南白药	5,000	299,750.00	0.12
48	002867	周大生	17,500	254,275.00	0.11
49	300759	康龙化成	4,900	125,930.00	0.05
50	002027	分众传媒	10,600	74,518.00	0.03
51	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.03
52	002003	伟星股份	3,100	43,927.00	0.02
53	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.02
54	688726	拉普拉斯	874	28,894.44	0.01
55	688449	联芸科技	949	27,938.56	0.01
56	688615	合合信息	149	24,701.22	0.01
57	603072	天和磁材	1,871	23,013.30	0.01
58	301522	上大股份	816	20,269.44	0.01
59	300896	爱美客	100	18,250.00	0.01
60	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.01
61	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
62	301622	英思特	306	13,745.52	0.01
63	603605	珀莱雅	143	12,112.10	0.01
64	001391	国货航	1,773	12,056.40	0.00
65	301606	绿联科技	308	11,238.92	0.00
66	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
67	301631	壹连科技	95	9,686.20	0.00
68	301603	乔锋智能	228	9,571.44	0.00
69	301617	博苑股份	220	8,753.80	0.00
70	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
71	300979	华利集团	100	7,865.00	0.00
72	600036	招商银行	200	7,860.00	0.00
73	600600	青岛啤酒	95	7,687.40	0.00
74	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
75	301026	浩通科技	203	5,562.20	0.00
76	600612	老凤祥	100	5,427.00	0.00
77	301333	诺思格	100	4,999.00	0.00
78	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
79	603369	今世缘	100	4,523.00	0.00
80	301080	百普赛斯	100	4,414.00	0.00
81	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
82	002315	焦点科技	100	4,168.00	0.00
83	603868	飞科电器	100	4,152.00	0.00
84	688212	澳华内镜	100	4,018.00	0.00
85	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
86	603816	顾家家居	113	3,116.54	0.00
87	300633	开立医疗	100	2,939.00	0.00
88	603285	键邦股份	124	2,803.64	0.00
89	002142	宁波银行	99	2,406.69	0.00

90	603310	巍华新材	131	2,351.45	0.00
91	688062	迈威生物	109	2,201.80	0.00
92	002001	新 和 成	100	2,197.00	0.00
93	688302	海创药业	71	2,180.41	0.00
94	301073	君亭酒店	100	2,087.00	0.00
95	601166	兴业银行	100	1,916.00	0.00
96	300879	大叶股份	100	1,568.00	0.00
97	002078	太阳纸业	100	1,487.00	0.00
98	002507	涪陵榨菜	100	1,413.00	0.00
99	603866	桃李面包	214	1,412.40	0.00
100	688192	迪哲医药	28	1,161.16	0.00
101	601339	百隆东方	200	1,088.00	0.00
102	600483	福能股份	100	997.00	0.00
103	600916	中国黄金	100	862.00	0.00
104	600398	海澜之家	100	750.00	0.00
105	600023	浙能电力	100	566.00	0.00
106	002154	报 喜 鸟	100	441.00	0.00
107	002127	南极电商	100	440.00	0.00
108	688321	微芯生物	2	37.16	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600872	中炬高新	16,713,500.00	5.79
2	000568	泸州老窖	15,779,116.35	5.47
3	000895	双汇发展	15,131,681.00	5.24
4	000858	五 粮 液	14,777,300.00	5.12
5	600690	海尔智家	13,607,643.00	4.72
6	688336	三生国健	13,299,084.81	4.61
7	000915	华特达因	12,803,178.00	4.44
8	600415	小商品城	12,770,977.00	4.43
9	300498	温氏股份	12,646,859.66	4.38
10	002311	海大集团	12,370,322.80	4.29
11	688266	泽璟制药	12,177,109.89	4.22
12	688062	迈威生物	12,051,175.29	4.18
13	301363	美好医疗	11,766,996.10	4.08
14	600887	伊利股份	11,321,614.00	3.92
15	301498	乖宝宠物	10,934,949.76	3.79
16	300760	迈瑞医疗	10,551,804.00	3.66
17	600750	江中药业	10,388,514.44	3.60

18	000423	东阿阿胶	10,345,094.04	3.59
19	000729	燕京啤酒	10,304,930.00	3.57
20	600809	山西汾酒	9,938,206.00	3.44
21	002714	牧原股份	9,918,884.00	3.44
22	300558	贝达药业	9,766,890.00	3.38
23	000333	美的集团	9,684,277.00	3.36
24	600079	人福医药	9,498,460.00	3.29
25	300347	泰格医药	9,483,995.00	3.29
26	600566	济川药业	9,074,371.00	3.14
27	002154	报喜鸟	8,949,985.00	3.10
28	300298	三诺生物	8,858,431.00	3.07
29	300119	瑞普生物	8,662,663.00	3.00
30	601019	山东出版	8,615,668.00	2.99
31	600132	重庆啤酒	8,419,209.00	2.92
32	603558	健盛集团	8,398,396.00	2.91
33	002867	周大生	8,251,314.00	2.86
34	300979	华利集团	8,160,356.00	2.83
35	300783	三只松鼠	8,125,455.00	2.82
36	600285	羚锐制药	8,123,075.48	2.82
37	600600	青岛啤酒	8,120,349.00	2.81
38	601128	常熟银行	8,110,163.20	2.81
39	603365	水星家纺	7,846,016.00	2.72
40	002755	奥赛康	7,699,791.00	2.67
41	002142	宁波银行	7,639,360.00	2.65
42	600916	中国黄金	7,618,272.00	2.64
43	600036	招商银行	7,604,911.00	2.64
44	003010	若羽臣	7,543,912.80	2.61
45	603345	安井食品	7,538,969.00	2.61
46	603889	新澳股份	7,537,177.08	2.61
47	603193	润本股份	7,320,750.00	2.54
48	002891	中宠股份	7,268,962.00	2.52
49	600298	安琪酵母	7,043,725.00	2.44
50	688192	迪哲医药	6,994,377.98	2.42
51	688131	皓元医药	6,858,849.64	2.38
52	600085	同仁堂	6,806,137.00	2.36
53	002946	新乳业	6,713,671.00	2.33
54	300662	科锐国际	6,636,453.00	2.30
55	688235	百济神州	6,568,645.33	2.28
56	002003	伟星股份	6,312,318.00	2.19
57	688105	诺唯赞	6,096,359.79	2.11
58	000739	普洛药业	5,994,326.40	2.08
59	688428	诺诚健华	5,928,186.96	2.05
60	601166	兴业银行	5,824,428.00	2.02

61	000513	丽珠集团	5,804,615.74	2.01
62	601607	上海医药	5,773,103.00	2.00

8.4.2 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	600079	人福医药	21,243,351.00	7.36
2	688266	泽璟制药	20,860,748.46	7.23
3	600519	贵州茅台	17,112,141.00	5.93
4	002262	恩华药业	16,855,802.00	5.84
5	688336	三生国健	14,109,638.59	4.89
6	000423	东阿阿胶	13,956,086.00	4.84
7	300558	贝达药业	13,333,259.00	4.62
8	000999	华润三九	12,756,597.68	4.42
9	688062	迈威生物	12,596,731.46	4.37
10	300498	温氏股份	12,018,062.66	4.17
11	301363	美好医疗	11,701,360.17	4.06
12	300760	迈瑞医疗	10,753,257.00	3.73
13	000915	华特达因	10,470,288.00	3.63
14	603259	药明康德	10,467,194.00	3.63
15	600276	恒瑞医药	10,416,528.20	3.61
16	600750	江中药业	10,287,062.30	3.57
17	002755	奥赛康	9,917,054.00	3.44
18	002714	牧原股份	9,780,760.20	3.39
19	600285	羚锐制药	9,758,239.84	3.38
20	000895	双汇发展	9,708,247.00	3.36
21	300705	九典制药	9,492,990.40	3.29
22	003010	若羽臣	9,181,462.60	3.18
23	603558	健盛集团	9,087,697.00	3.15
24	002154	报喜鸟	9,076,988.00	3.15
25	603365	水星家纺	9,061,316.00	3.14
26	300979	华利集团	8,979,169.00	3.11
27	688428	诺诚健华	8,872,003.26	3.07
28	600809	山西汾酒	8,860,465.00	3.07
29	600690	海尔智家	8,828,862.00	3.06
30	600132	重庆啤酒	8,681,408.00	3.01
31	300298	三诺生物	8,615,506.00	2.99
32	601607	上海医药	8,580,286.00	2.97
33	600415	小商品城	8,564,607.00	2.97
34	000858	五粮液	8,527,743.00	2.96
35	600566	济川药业	8,470,252.00	2.94
36	300347	泰格医药	8,176,921.00	2.83

37	600916	中国黄金	8,125,957.00	2.82
38	601128	常熟银行	8,057,873.00	2.79
39	002003	伟星股份	7,937,121.00	2.75
40	600036	招商银行	7,893,686.00	2.74
41	600872	中炬高新	7,828,896.64	2.71
42	603889	新澳股份	7,743,584.54	2.68
43	600557	康缘药业	7,733,986.80	2.68
44	000513	丽珠集团	7,708,630.00	2.67
45	002142	宁波银行	7,676,495.00	2.66
46	000963	华东医药	7,599,651.00	2.63
47	688192	迪哲医药	7,542,360.21	2.61
48	688235	百济神州	7,324,050.25	2.54
49	000568	泸州老窖	7,226,313.00	2.50
50	300406	九强生物	6,924,270.00	2.40
51	002867	周大生	6,779,914.96	2.35
52	600535	天士力	6,292,777.00	2.18
53	300723	一品红	6,286,468.00	2.18
54	603368	柳药集团	6,268,059.72	2.17
55	688131	皓元医药	6,253,419.40	2.17
56	000739	普洛药业	6,204,658.20	2.15
57	601019	山东出版	6,177,261.32	2.14
58	688105	诺唯赞	6,109,797.06	2.12
59	600976	健民集团	6,055,345.60	2.10

8.4.3 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	926,405,998.72
卖出股票收入（成交）总额	905,923,206.43

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金本报告期末投资基金。

8.12.2 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

注：本基金本报告期末未持有基金。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

8.13.3 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	143,922.04
2	应收清算款	121,933.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,677.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	300,532.65

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
浙商大数据智选消费 A	31,422	4,761.67	40,679.59	0.03	149,580,513.29	99.97
浙商大数据智选消费 C	125	7,371.97	700,723.16	76.04	220,773.38	23.96
合计	31,547	4,772.01	741,402.75	0.49	149,801,286.67	99.51

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。

9.2 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	浙商大数据智选消费 A	131,567.10	0.0879
	浙商大数据智选消费 C	0.00	0.0000
	合计	131,567.10	0.0874

9.3 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	浙商大数据智选消费 A	10~50
	浙商大数据智选消费 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	浙商大数据智选消费 A	0
	浙商大数据智选消费 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金无期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浙商大数据智选消费 A	浙商大数据智选消费 C
基金合同生效日 （2017 年 1 月 11 日） 基金份额总额	488,689,300.96	—
本报告期期初基金份额总额	168,765,378.07	194,021.93
本报告期基金总申购份额	14,204,211.42	999,550.06
减：本报告期基金总赎回份额	33,348,396.61	272,075.45
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	149,621,192.88	921,496.54

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

报告期内，基金管理人的重大人事变动：

2024 年 6 月 27 日，王瑞华女士离任浙商基金管理有限公司副总经理职务；

2024 年 11 月 6 日，王波先生离任浙商基金管理有限公司总经理和财务负责人职务；

2024 年 11 月 6 日，刘岩先生担任浙商基金管理有限公司总经理和财务负责人职务。

报告期内，经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所，本报告年度的审计费用为 50,000.00 元。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 10 月 12 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会浙江监管局
受到的具体措施类型	责令改正措施
受到稽查或处罚等措施的原因	个别内控机制未有效执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已及时按要求完成全部整改
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	时任总经理王波先生
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 10 月 12 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会浙江监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	对基金管理人上述情形负有管理责任
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已及时按要求完成全部整改

其他	-
----	---

11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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(%)	
华创证券	1	297,832,758.91	16.27	132,803.51	12.30	-
摩根大通	1	280,210,717.74	15.31	174,218.44	16.14	-
广发证券	1	252,556,836.35	13.80	112,615.33	10.43	-
财通证券	2	240,848,241.03	13.16	107,396.66	9.95	-
兴业证券	1	220,917,079.12	12.07	162,843.50	15.09	-
野村东方国际证券	1	181,865,598.95	9.94	122,706.50	11.37	-
东方证券	2	117,128,022.90	6.40	52,227.35	4.84	-
方正证券	1	83,077,055.94	4.54	77,626.49	7.19	-
信达证券	1	63,983,464.84	3.50	60,526.59	5.61	-
东方财富证券	1	44,979,332.46	2.46	42,546.51	3.94	-
川财证券	1	26,224,719.28	1.43	24,805.15	2.30	-
天风证券	1	20,487,379.82	1.12	9,135.66	0.85	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

本基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- （1）注册资本符合规定；
- （2）财务状况良好；
- （3）无重大违法违规记录；
- （4）符合监管评级的等级标准；
- （5）具备规范的公司治理结构及健全的合规、风险管理和内部控制制度；
- （6）其他监管规定的相关要求。

2、券商专用交易单元选择程序：

- （1）本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用交易席位的证券经营机构；
- （2）本基金管理人与选定的证券经营机构签订协议。

3、本基金报告期内券商交易单元变更情况：

（1）新增或退租券商交易单元：新增麦高证券（61404）；新增天风证券（010394）；退租华创证券（45590）；退租光大证券（38750）；退租东北证券（38768）；退租中泰证券（004123）；退租中信建投证券（012685）。

（2）上表中所列交易单元均与浙商日添利货币市场基金和浙商丰利增强债券型证券投资基金共用。

4、上述数据的报告期为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，官方网站首次披露的《浙商银行管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。

11.8.2 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	
	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(%)
华创证券	-	-	70,000,000.00	50.00	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

兴业证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	70,000,000.0 0	50.00	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
麦高证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-

11.9 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	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 19 日
2	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 30 日
3	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 19 日
4	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
5	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 5 日
6	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 5 日
7	浙商大数据智选消费灵活配置混合型	中国证监会指定报刊及	2024 年 7 月 19 日

	证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	网站	
8	浙商基金管理有限公司关于浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金新增申万宏源证券西部有限公司为销售机构并参加费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 12 日
9	浙商基金管理有限公司关于浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金新增申万宏源证券有限公司为销售机构并参加费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 12 日
10	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 30 日
11	浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 25 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 (%)
产品特有风险							
(1) 赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险。 (2) 基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动； (3) 提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于 5,000 万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算。 (4) 基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。							

注：本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金设立的相关文件；
- 2、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 3、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.zsfund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-067-9908/021-60359000 查询相关信息。

浙商基金管理有限公司

2025 年 3 月 29 日