

浙商中证 500 指数增强型证券投资基金证  
券投资基金（原浙商聚潮灵活配置混合型  
证券投资基金基金转型）  
2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 26 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。本半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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	9
3.2 基金净值表现（转型前）.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....	<b>47</b>
6.1 资产负债表.....	47
6.2 利润表.....	48
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	49
6.4 报表附注.....	50
<b>§7 投资组合报告（转型后）</b> .....	<b>76</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	76
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	76
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.....	78
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	83

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	84
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 .....	85
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细 .....	85
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 .....	85
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 .....	85
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	85
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	85
7.12 投资组合报告附注 .....	86
<b>§7 投资组合报告（转型前） .....</b>	<b>88</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	88
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	88
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 .....	89
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	97
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	99
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 .....	100
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细 .....	100
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 .....	100
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 .....	100
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	100
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	101
7.12 投资组合报告附注 .....	101
<b>§8 基金份额持有人信息（转型后） .....</b>	<b>103</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	103
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	103
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的情况 .....	103
<b>§8 基金份额持有人信息（转型前） .....</b>	<b>104</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	104
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	104
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的情况 .....	104
<b>§9 开放式基金份额变动(转型后) .....</b>	<b>105</b>
<b>§9 开放式基金份额变动(转型前) .....</b>	<b>106</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>107</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	107
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 .....	107
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	107
10.4 基金投资策略的改变 .....	107
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	107
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	107
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后） .....	107
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前） .....	109
10.9 其他重大事件（转型后） .....	110
10.9 其他重大事件（转型前） .....	112
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>114</b>
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 .....	114
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	114

<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>115</b>
12.1 备查文件目录.....	115
12.2 存放地点.....	115
12.3 查阅方式.....	115

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	浙商中证 500 增强	
基金主代码	002076	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 4 月 24 日	
基金管理人	浙商基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	57,289,998.75 份	
下属分级基金的基金简称	浙商中证 500 增强 A	浙商中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码	002076	007386
报告期末下属分级基金的份额总额	57,289,467.74 份	531.01 份

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	浙商灵活配置
基金主代码	002076
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 11 日
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	57,287,453.24 份

### 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金通过严格的投资程序约束和量化风险管理手段，在对标的指数有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 8%。
投资策略	本基金将运用指数化的投资方法，在控制组合跟踪误差基础上（年化跟踪误差 4%-5%）调整成分股的权重，达到对标的指数的跟踪目标。 本基金主要依据浙商指数增强模型，在控制投资组合跟踪误差的基础上，对股票组合进行优化，力争获得超越基准的回报。

业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，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混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金通过准确把握中国经济周期变动特征，挖掘不同经济周期阶段下优势资产及行业投资机会，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金采用定量分析和定性分析相结合的方法，深入研究我国经济周期当前所处阶段（复苏、扩张、滞胀和衰退）及未来发展方向，确定不同经济周期阶段下的资产配置和行业投资策略，在有效控制风险的前提下，精选优质上市公司股票构建投资组合，力求获得较高的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为主动投资的混合型基金，其预期风险和收益高于债券型基金、货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

## 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	陆志俊
	联系电话	021-60350812	95559
	电子邮箱	guoleqi@zsfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	95559
传真		0571-28191919	021-62701216
注册地址		浙江省杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		浙江省杭州市西湖区教工路 18 号 世贸丽晶欧美中心 B 座 507 室	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		310012	200120
法定代表人		肖风	彭纯

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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
注册登记机构	浙商基金管理有限公司	浙江省杭州市西湖区教工路18号世贸丽晶城欧美中心B座507室

## § 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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	浙商中证 500 增强 A	浙商中证 500 增强 C
本期已实现收益	-3,918,937.91	-36.99
本期利润	-4,489,361.99	-26.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0784	-0.0539
本期加权平均净值利润率	-8.89%	-6.17%
本期基金份额净值增长率	-8.07%	-8.11%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年 6 月 30 日	
期末可供分配利润	-6,134,456.36	-57.09
期末可供分配基金份额利润	-0.1071	-0.1075
期末基金资产净值	51,155,011.38	473.92
期末基金份额净值	0.8929	0.8925
3.1.3 累计期末指标	2019 年 6 月 30 日	
基金份额累计净值增长率	-8.07%	-8.11%

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日	
本期已实现收益	11,161,753.99	
本期利润	14,617,316.45	
加权平均基金份额本期利润	0.2289	
本期加权平均净值利润率	26.47%	
本期基金份额净值增长率	30.17%	
3.1.2 期末数据和指标	2019 年 4 月 23 日	
期末可供分配利润	-1,641,385.98	
期末可供分配基金份额利润	-0.0287	
期末基金资产净值	55,646,067.26	
期末基金份额净值	0.9713	
3.1.3 累计期末指标	2019 年 4 月 23 日	
基金份额累计净值增长率	-2.87%	

### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 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

浙商中证 500 增强 A

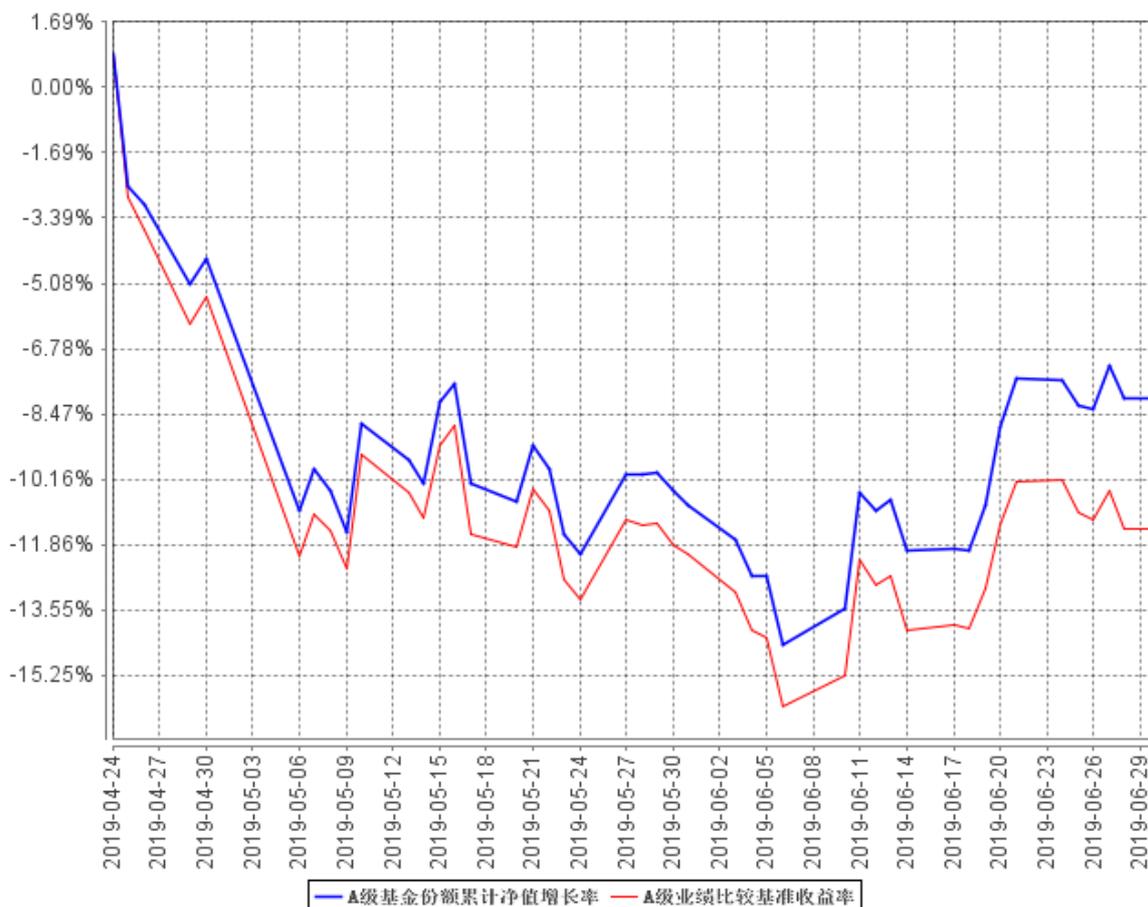
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.09%	1.32%	0.75%	1.32%	2.34%	0.00%
自基金合同生效起至今	-8.07%	1.77%	-11.44%	1.83%	3.37%	-0.06%

浙商中证 500 增强 C

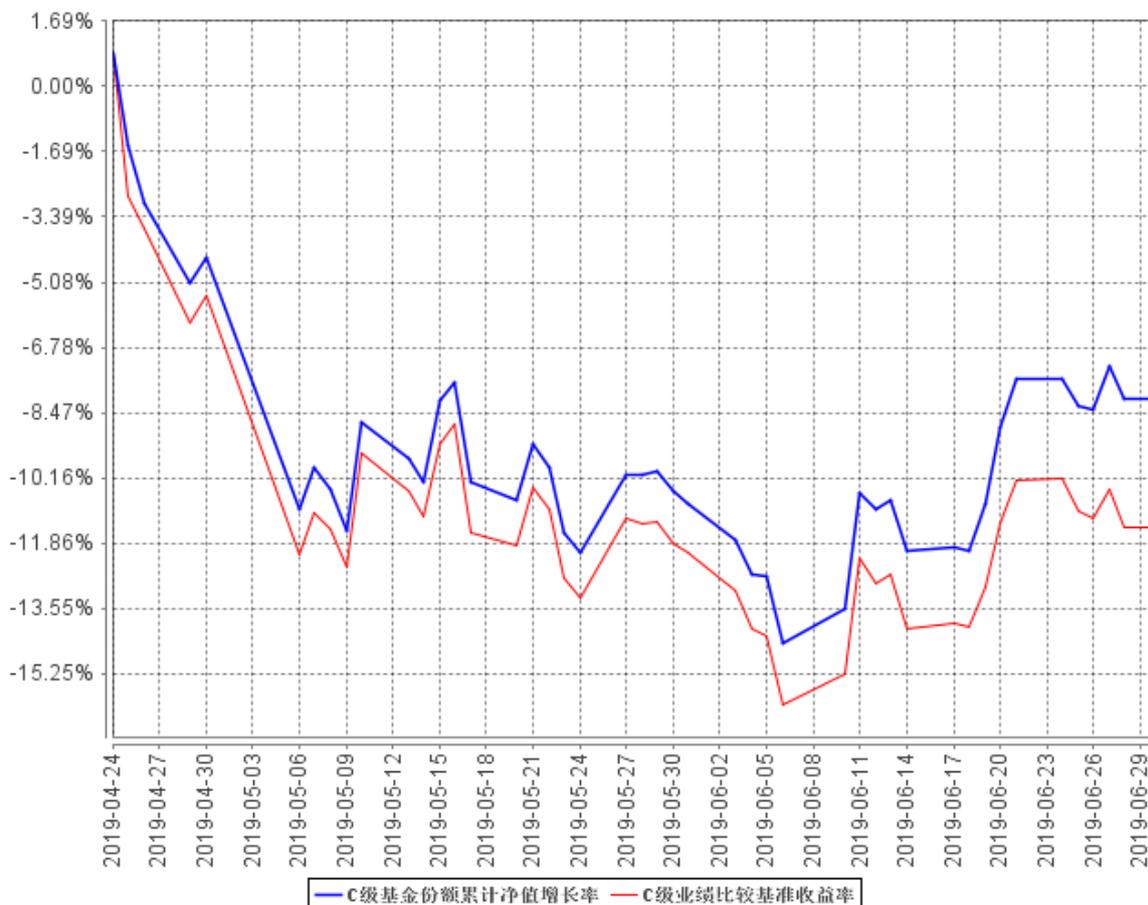
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.07%	1.32%	0.75%	1.32%	2.32%	0.00%
自基金合同生效起至今	-8.11%	1.75%	-11.44%	1.83%	3.33%	-0.08%

### 3.2.2 自基金转型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

A级基金份额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



C级基金份额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、本基金由浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金转型而来，本基金基金合同生效日为 2019 年 4 月 24 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金转型未满一年。  
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应符合基金合同约定。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

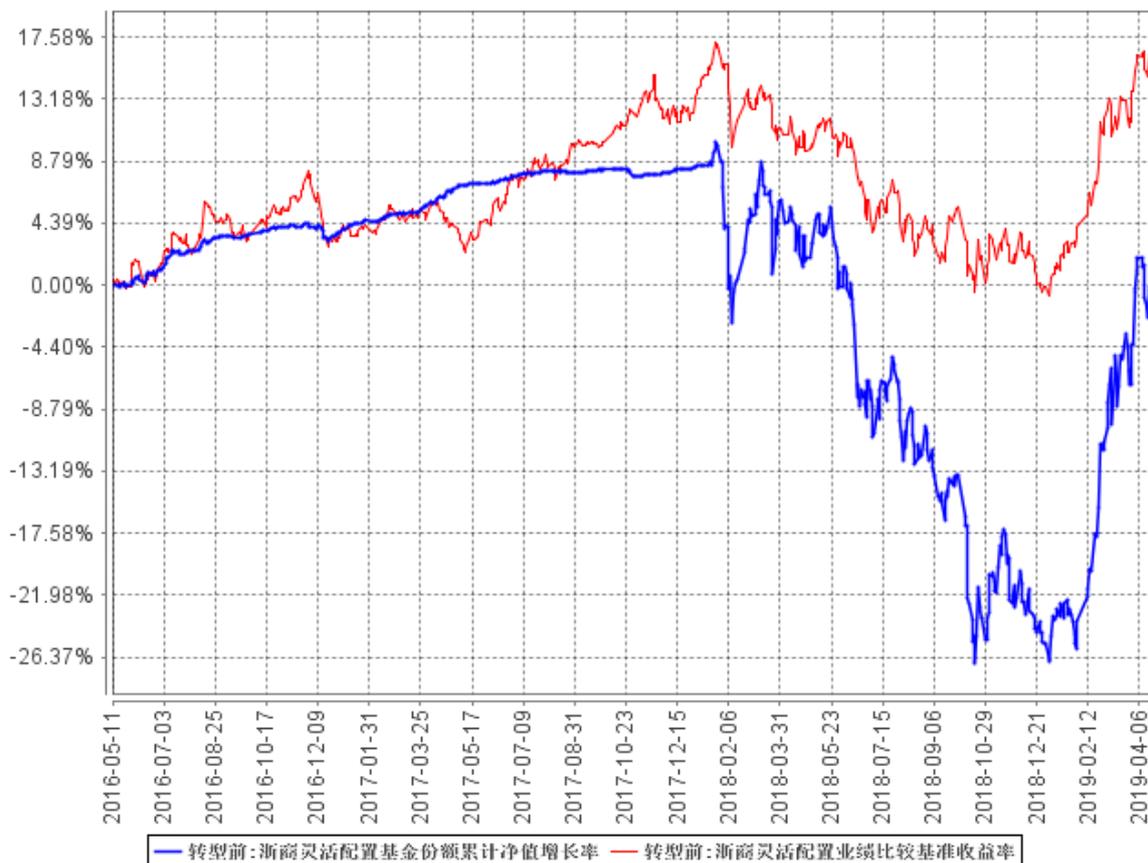
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.44%	1.47%	1.41%	0.68%	0.03%	0.79%
过去三个月	30.96%	1.75%	11.65%	0.84%	19.31%	0.91%
过去六个月	27.18%	1.50%	13.69%	0.71%	13.49%	0.79%
过去一年	-4.73%	1.48%	5.30%	0.72%	-10.03%	0.76%
自基金合同生效起至今	-2.87%	0.94%	15.36%	0.53%	-18.23%	0.41%

注：本表格中净值增长率基准日为转换日。

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

浙商灵活配置基金份额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 2016 年 5 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，从 2016 年 5 月 11 日至 2016 年 11 月 10 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浙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。公司股东为浙商证券股份有限公司、通联资本管理有限公司、养生堂有限公司、浙大网新集团有限公司,四家股东各出资 7500 万元,公司注册资本 3 亿元人民币。注册地为浙江省杭州市。

截至 2019 年 6 月 30 日,浙商基金共管理十五只开放式基金——浙商大数据智选消费混合型证券投资基金、浙商沪深 300 指数分级证券投资基金、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、浙商惠南纯债债券型证券投资基金、浙商惠享纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈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、浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金、浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合证券投资基金、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、浙商日添金货币市场基金、浙商全景消费混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型后)

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		
王剑	本基金的基金经理助理	2018 年 8 月 24 日	-	4	王剑先生,复旦大学光学博士,历任上海东证期货有限公司研究所研究员等职务,2015 年加入浙商基金管理有限公司,目前任职于智能投资部。
查晓磊	本基金的基金经理,公司智能投资部总经理	2018 年 1 月 12 日	-	8	查晓磊先生,香港中文大学财务学博士。历任博时基金管理有限公司投资策略及大宗商品分析师。
周锦程	本基金的基金经理	2017 年 9 月 18 日	2019 年 5 月 31 日	8	周锦程先生,复旦大学经济学硕士。历任德邦证券股份有限公司债券交易员、债券研究员、债券投资经理。

注:王剑于 2019 年 8 月 7 日担任本基金的基金经理。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
王剑	本基金的基金经理助理	2018年8月24日	-	4	王剑先生, 复旦大学光学博士, 历任上海东证期货有限公司研究所研究员等职务, 2015年加入浙商基金管理有限公司, 目前任职于智能投资部。
查晓磊	本基金的基金经理, 公司智能投资部总经理	2018年1月12日	-	8	查晓磊先生, 香港中文大学财务学博士。历任博时基金管理有限公司投资策略及大宗商品分析师。
周锦程	本基金的基金经理	2017年9月18日	-	8	周锦程先生, 复旦大学经济学硕士。历任德邦证券股份有限公司债券交易员、债券研究员、债券投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

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, 本公司金融工程小组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。

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 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

本基金在报告期内，按照中证 500 指数增强策略操作。本基金通过投资约束和数量化控制，按照基金合同的要求，使用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，积极应对市场的剧烈变化，努力将基金的跟踪误差控制在较低水平下，实现增强策略，达到产生相对基准超额收益的投资目的。报告期内，本基金持续优化指数跟踪策略，针对基金规模小，申购赎回对净值波动影响大的情况，尽力做了应对。二季度基金较好的完成了跟踪目标的同时，各类模型运行稳定，获得了一定幅度的超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前，截至转型期末本基金份额净值为 0.9713 元，本报告期基金份额净值增长率为 30.17%，业绩比较基准收益率为 15.50%；转型后，截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 0.8929 元，本报告期基金 A 类份额净值增长率为-8.07%，业绩比较基准收益率为-11.44%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 0.8925 元，本报告期基金 C 类份额净值增长率为-8.11%，业绩比较基准收益率为-11.44%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济整体上仍可能走成低波动状态。增长还不具备快速复苏的条件，但向下具备了一定的韧性，短期内不太会有失速的风险。通胀则可能暂时度过了上升最快的时期，接下来的几个月可能在中高水平波动，下一个压力时期可能是在年底。货币流动性在 6 月份有所上升，但整个经济体的信用传导渠道仍然没有十分通畅，全面宽松的可能性也不大。外部环境仍然充满不确定性，汇率的波动压力继续存在。因此，综合来看，宏观经济的各个层面大体呈现出一个紧平衡的状态。

对于市场，经过了一季度的快速上涨，第二季度的回调，三季度大概率呈现震荡的格局，趋势性的拐点还不明确。目前股票市场的整体估值水平中低，长期的股票的相对吸引力仍优于债券，

这是决定股票配置中枢的主要因素。因此，股票配置的仓位水平不倾向于过低，应对前面所判断的有可能的市场大幅波动，更主要的是结构上调整与对冲。具体来看，价值和基本面因子的重要性继续提升，相比不断降低的债券收益率，股息率将变得更加宝贵。因此，接下来组合的结构调整将向更加低估值倾斜，重视股息率，对于估值过高的行业和公司，将进行显著的权重降低。

#### **4.6 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，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，会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。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。公司估值委员会成员中不包括基金经理。报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金在本报告期末进行收益分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内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

2019 年上半年度，基金托管人在浙商中证 500 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2019 年上半年度，浙商基金管理有限公司在浙商中证 500 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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

2019 年上半年度，由浙商基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关浙商中证 500 指数增强型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

## 6.1 资产负债表

会计主体：浙商中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	655,043.41
结算备付金		242,657.99
存出保证金		23,555.18
交易性金融资产	6.4.7.2	50,454,153.37
其中：股票投资		47,937,644.37
基金投资		-
债券投资		2,516,509.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	63,471.17
应收股利		-
应收申购款		9.99
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		51,438,891.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		26,272.65
应付管理人报酬		20,404.49
应付托管费		4,080.89
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	129,949.86
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	102,697.92
负债合计		283,405.81
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	57,289,998.75
未分配利润	6.4.7.10	-6,134,513.45
所有者权益合计		51,155,485.30
负债和所有者权益总计		51,438,891.11

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，浙商中证 500 增强 A 基金份额净值 0.8929 元，基金份额总额 57289467.74 份；浙商中证 500 增强 C 基金份额净值 0.8925 元，基金份额总额 531.01 份。浙商中证 500 增强份额总额合计为 57289998.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：浙商中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年4月24日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
一、收入		-4,240,209.37
1. 利息收入		16,645.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,997.09
债券利息收入		14,648.21
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,687,243.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,073,743.83
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-884.08
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	387,384.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-570,413.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	802.14

<b>减：二、费用</b>		249,178.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	47,098.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,419.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	122,088.33
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	70,572.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,489,388.07
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,489,388.07

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	57,287,453.24	-1,641,385.98	55,646,067.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,489,388.07	-4,489,388.07
三、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)	2,545.51	-3,739.40	-1,193.89
其中：1. 基金申购款	183,746.40	-19,968.81	163,777.59
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-181,200.89	16,229.41	-164,971.48
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	57,289,998.75	-6,134,513.45	51,155,485.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
聂挺进

\_\_\_\_\_  
唐生林

\_\_\_\_\_  
唐生林

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

浙商中证 500 指数增强型证券投资基金（原浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“原基金”））（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”）《关于准予浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕1578 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》等相关法规和《浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2016 年 5 月 11 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为浙商基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

根据《浙商基金管理有限公司关于浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，原基金将在基金份额转换基准日（2019 年 4 月 24 日）进行基金份额转换，基金份额转换完成后原基金的基金类型由混合型基金变更为股票型基金，基金名称由“浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金”变更为“浙商中证 500 指数增强型证券投资基金”。于 2019 年 4 月 24 日，《浙商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，基金规模为 57,242,904.27 基金份额。本基金的基金管理人为浙商基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《浙商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《浙商中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，以中证 500 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、债券（包括国债、央行票据、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资票据、超短期融资票据、次级债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、股指期货、权证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）。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货保证金以后基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中

证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本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〈年度报告和半年度报告〉》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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况、2019 半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 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。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资

产。本基金现无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。

本基金目前持有的债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

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：

所转移金融资产的账面价值

因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 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。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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。

#### **6.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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。

#### **6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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 /（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债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成本的差额确认。

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。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

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、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

#### 6.4.4.10 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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别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；

基金同一基金份额类别内的每份基金份额享有同等收益分配权，但由于本基金 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；

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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》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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后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费附加。

## 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	655,043.41
定期存款	-
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	-
合计：	655,043.41

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	48,285,768.79	47,937,644.37	-348,124.42
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,526,938.57	2,516,509.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,526,938.57	2,516,509.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	50,812,707.36	50,454,153.37	-358,553.99

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金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 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	109.37
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	98.28
应收债券利息	63,253.97
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.01

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	9.54
合计	63,471.17

注：其他列示的是应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	129,949.86
银行间市场应付交易费用	-
合计	129,949.86

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	30.54
预提费用	65,304.74
指数使用费	37,362.64
合计	102,697.92

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

浙商中证 500 增强 A		
项目	本期 2019年4月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	57,287,453.24	57,287,453.24
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	183,215.39	183,215.39

本期赎回(以“-”号填列)	-181,200.89	-181,200.89
本期末	57,289,467.74	57,289,467.74

金额单位：人民币元

浙商中证 500 增强 C		
项目	本期 2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	531.01	531.01
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	531.01	531.01

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

浙商中证 500 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-3,918,937.91	-570,424.08	-4,489,361.99
本期基金份额交易产生的变动数	1,466.76	-5,175.15	-3,708.39
其中：基金申购款	-11,560.59	-8,377.21	-19,937.80
基金赎回款	13,027.35	3,202.06	16,229.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,917,471.15	-575,599.23	-4,493,070.38

金额单位：人民币元

浙商中证 500 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-36.99	10.91	-26.08
本期基金份额交易产生的变动数	-11.57	-19.44	-31.01

其中：基金申购款	-11.57	-19.44	-31.01
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-48.56	-8.53	-57.09

#### 6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2019年4月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日
活期存款利息收入	885.37
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	1,029.95
其他	81.77
合计	1,997.09

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日
卖出股票成交总额	39,339,091.54
减：卖出股票成本总额	43,412,835.37
买卖股票差价收入	-4,073,743.83

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-884.08
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-884.08

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年4月24日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	307,000.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	301,424.08
减：应收利息总额	6,460.27
买卖债券差价收入	-884.08

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期无衍生工具投资收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金在本报告期无衍生工具投资收益-其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	387,384.27
基金投资产生的股利收益	-
合计	387,384.27

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年4月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-570,413.17
——股票投资	-559,271.25
——债券投资	-11,141.92
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-570,413.17

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日
基金赎回费收入	802.14
合计	802.14

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
交易所市场交易费用	122,088.33
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	122,088.33

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
审计费用	9,315.32
信息披露费	14,594.84
其他	300.00
指数使用费	37,362.64
债券帐户维护费	9,000.00
合计	70,572.80

### 6.4.7.21 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。

## 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。

### 6.4.8.2 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。

## 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 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
浙商基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
浙商证券股份有限公司	基金管理人的股东
通联资本管理有限公司	基金管理人的股东
浙江浙大网新集团有限公司	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	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期没有应支付关联方的佣金。

### 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
	2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	47,098.00
其中：支付销售机构的客户维护费	151.13

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的一定比例计提，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×0.5%/当年天数（自 2019 年 4 月 24 日（基金合同生效日）起）

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,419.57

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值的一定比例计提，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×0.1%/当年天数（自 2019 年 4 月 24 日（基金合同生效日）起）

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	浙商中证 500 增强 A	浙商中证 500 增强 C	合计
浙商基金管理有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费率按年费率 0.35%。支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

浙商中证 500C 基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.35%/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

本基金在本报告期没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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 2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	浙商中证 500 增强 A	浙商中证 500 增强 C
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：报告期内基金管理人未持有过本基金。

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

浙商中证 500 增强 A	
关联方名称	本期末 2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
--	-------------	----------------------

份额单位：份

浙商中证 500 增强 C		
关联方名称	本期末 2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末持有本基金。

#### 6.4.10.5 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 2019 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	655,043.41	885.37

注：本基金通过“交通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 2019 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 242,657.99 元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

浙商中证 500 增强 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					

合计	-	-	-	-	-	-	-	-
----	---	---	---	---	---	---	---	---

浙商中证 500 增强 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金在本期间未进行过利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	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	说明
601236	红塔 证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通 受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

注：根据《证券发行与承销管理办法》，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。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

##### 6.4.12.17 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.18.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.18.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 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。

本基金的基金管理人建立了以合规与风险控制委员会为核心的，由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向合规与风险控制委员会提交独立的监察稽核报告和建议；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责。

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。

##### 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交通银行，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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	2,516,509.00
合计	2,516,509.00

注：本报告期末的未评级债券为政策性金融债，本基金于 2019 年 4 月 24 日转型，故无上年度可比较数据。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末未持有短期资产支持证券资产。本基金于 2019 年 4 月 24 日转型，故无上年度可比较数据。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末未持有短期同业存单投资。本基金于 2019 年 4 月 24 日转型，故无上年度可比较数据。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末未持有长期信用债券投资。本基金于 2019 年 4 月 24 日转型，故无上年度可比较数据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末未持有长期资产支持证券投资。本基金于 2019 年 4 月 24 日转型，故无上年

度可比较数据。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本期末未持有长期同业存单投资。本基金于 2019 年 4 月 24 日转型，故无上年度可比较数据。

#### **6.4.13.3 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。

##### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

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。

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。

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（所有者权益）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。

#### **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

利率风险是指金融工具的公允价值或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、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2019年6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	655,043.41	-	-	-	-	-	655,043.41
结算备付金	242,657.99	-	-	-	-	-	242,657.99
存出保证金	23,555.18	-	-	-	-	-	23,555.18
交易性金融资产	-	2,516,509.00	-	-	-	47,937,644.37	50,454,153.37
应收利息	-	-	-	-	-	63,471.17	63,471.17
应收申购款	-	-	-	-	-	9.99	9.99
资产总计	921,256.58	2,516,509.00	-	-	-	48,001,125.53	51,438,891.11
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	26,272.65	26,272.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,404.49	20,404.49
应付托管费	-	-	-	-	-	4,080.89	4,080.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	129,949.86	129,949.86
其他负债	-	-	-	-	-	102,697.92	102,697.92
负债总计	-	-	-	-	-	283,405.81	283,405.81
利率敏感度缺口	921,256.58	2,516,509.00	-	-	-	47,717,719.72	51,155,485.30

##### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2019 年 6 月 30 日）
	上升 25 基点	-1,041.83
	下降 25 基点	1,041.83

#### 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，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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债券，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的发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%；基金保留的现金或到期日在 1 年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%。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。

##### 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 2019 年 6 月 30 日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	47,937,644.37	93.71
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	2,516,509.00	4.92
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	50,454,153.37	98.63

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 ( 2019 年 6 月 30 日 )
	沪深 300 指数上升 5%	2,637,990.34
	沪深 300 指数下降 5%	-2,637,990.34

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。本基金于 2019 年 4 月 24 日转型, 故无上年度可比较数据。

#### 6.4.14 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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 6.1 资产负债表

会计主体：浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 4 月 23 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 4 月 23 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	688,719.85	731,868.72
结算备付金		602,455.90	290,747.95
存出保证金		32,399.19	19,774.95
交易性金融资产	6.4.7.2	54,532,104.11	50,323,345.59
其中：股票投资		51,703,029.11	47,501,601.59
基金投资		-	-
债券投资		2,829,075.00	2,821,744.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	56,409.28	75,326.09
应收股利		-	-
应收申购款		3,404.89	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		55,915,493.22	51,441,063.30
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 4 月 23 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,430.39	717.12
应付管理人报酬		18,036.58	22,275.00
应付托管费		3,607.30	4,454.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	54,957.11	263,503.10
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	191,394.58	150,000.00
负债合计		269,425.96	440,950.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	57,287,453.24	68,350,819.36
未分配利润	6.4.7.10	-1,641,385.98	-17,350,706.27
所有者权益合计		55,646,067.26	51,000,113.09
负债和所有者权益总计		55,915,493.22	51,441,063.30

## 6.2 利润表

会计主体：浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		15,269,195.46	-7,249,110.32
1. 利息收入		35,013.37	284,779.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,253.75	9,630.82
债券利息收入		30,759.62	223,175.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	51,973.10
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,776,734.05	25,643.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,751,999.29	-237,487.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-7,885.68	-84,080.50
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	32,620.44	347,212.14
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,455,562.46	-7,559,741.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,885.58	207.39
<b>减：二、费用</b>		651,879.01	340,741.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	85,251.21	128,803.77

2. 托管费	6.4.10.2.2	17,050.22	25,760.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	498,883.00	65,117.04
5. 利息支出		-	27,447.52
其中：卖出回购金融资产支出		-	27,447.52
6. 税金及附加		-	629.12
7. 其他费用	6.4.7.20	50,694.58	92,983.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		14,617,316.45	-7,589,852.27
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		14,617,316.45	-7,589,852.27

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	68,350,819.36	-17,350,706.27	51,000,113.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,617,316.45	14,617,316.45
三、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）	-11,063,366.12	1,092,003.84	-9,971,362.28
其中：1. 基金申购款	463,489.13	-28,141.34	435,347.79
2. 基金赎回款	-11,526,855.25	1,120,145.18	-10,406,710.07
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	57,287,453.24	-1,641,385.98	55,646,067.26
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金	50,225,199.27	4,172,081.04	54,397,280.31



其他资产占基金资产的比例范围为 5% - 100%，其中基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金以持续经营为基础。本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<年度报告和半年度报告>》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**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况、2019 半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策与最近一期年度会计报表所采用的会计政策一致。

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，本报告期为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日。

##### **6.4.4.2 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。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无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。

本基金目前持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-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：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，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。

#### 6.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比

例计算认列。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。

#### 6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债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成本的差额确认。

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。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

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、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红和红利再投资，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，本基金默认为的收益分配方式是现金分红。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。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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上

市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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》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)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）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。对资管产品在2018年1月1日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。

(e)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。

(f)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。

(g)对基金在2018年1月1日（含）以后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费附加。

## 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 2019 年 4 月 23 日
活期存款	688,719.85
定期存款	-
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	-
合计：	688,719.85

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 4 月 23 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	51,491,882.28	51,703,029.11	211,146.83
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,828,362.65	2,829,075.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,828,362.65	2,829,075.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	54,320,244.93	54,532,104.11	211,859.18
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	-	-	-
----	---	---	---

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 4 月 23 日
应收活期存款利息	495.84
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	801.15
应收债券利息	55,066.03
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	46.26
合计	56,409.28

注：其他列示的是应收结算保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 4 月 23 日
交易所市场应付交易费用	54,957.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	54,957.11

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 4 月 23 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	191,394.58
合计	191,394.58

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	68,350,819.36	68,350,819.36
本期申购	463,489.13	463,489.13
本期赎回（以“-”号填列）	-11,526,855.25	-11,526,855.25
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	57,287,453.24	57,287,453.24

### 6.4.7.10 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
上年度末	-13,961,257.44	-3,389,448.83	-17,350,706.27
本期利润	11,161,753.99	3,455,562.46	14,617,316.45
本期基金份额交易产生的变动数	1,505,131.03	-413,127.19	1,092,003.84

其中：基金申购款	-57,896.24	29,754.90	-28,141.34
基金赎回款	1,563,027.27	-442,882.09	1,120,145.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,294,372.42	-347,013.56	-1,641,385.98

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年4月23日
活期存款利息收入	2,034.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,086.67
其他	133.07
合计	4,253.75

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年4月23日
卖出股票成交总额	167,923,267.69
减：卖出股票成本总额	156,171,268.40
买卖股票差价收入	11,751,999.29

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年4月23日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,885.68
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-7,885.68

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月23日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	2,708,658.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,617,885.68
减：应收利息总额	98,658.00
买卖债券差价收入	-7,885.68

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金在本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金在本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金在本报告期无衍生工具投资收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金在本报告期无衍生工具投资收益-其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月23日
股票投资产生的股利收益	32,620.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	32,620.44

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年4月23日
1. 交易性金融资产	3,455,562.46
——股票投资	3,458,708.43
——债券投资	-3,145.97
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,455,562.46

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日
基金赎回费收入	1,885.58
合计	1,885.58

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日
交易所市场交易费用	498,883.00
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	498,883.00

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日
审计费用	15,479.87
信息披露费	25,914.71
其他	300.00
债券帐户维护费	9,000.00
合计	50,694.58

**6.4.7.21 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。

## 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。

### 6.4.8.2 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。

## 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 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
浙商基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
浙商证券股份有限公司	基金管理人的股东
通联资本管理有限公司	基金管理人的股东
浙江浙大网新集团有限公司	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	基金管理人的子公司

注：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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行股票交易。

### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期没有应支付关联方的佣金。

## 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 2019年1月1日至2019年4 月23日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	85,251.21	128,803.77
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	189.39	608.55

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的一定比例计提，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×1.0%/当年天数（自2016年5月11日（基金合同生效日）至2016年7月21日）

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.5%/当年天数（自2016年7月22日起）

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,050.22	25,760.74

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值的一定比例计提，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×0.25%/当年天数（自 2016 年 5 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 7 月 21 日）

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数（自 2016 年 7 月 22 日起）

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

#### 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

本基金在本报告期没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未持有过本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末持有本基金。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	688,719.85	2,034.01	808,691.18	7,189.52

注：本基金通过“交通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 2019 年 4 月 23 日的相关余额为人民币 602,455.90 元。(2018 年 6 月 30 日：人民币 299,460.28 元)

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金在本期间未进行过利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019 年 4 月 23 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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	说明	
603967	中创物流	2019 年 4 月 19 日	2019 年 4 月 29 日	新股流通受限	15.32	15.32	1,102	16,882.64	16,882.64	-	
300772	运达股份	2019 年 4 月 19 日	2019 年 4 月 26 日	新股流通受限	6.52	6.52	2,079	13,555.08	13,555.08	-	

##### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	说明
------	------	-------	------	--------	------	--------	----------	--------	--------	----

6.4.12.1.3 受限证券类别：权证											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：份)	期末成本总额	期末估值总额	说明	


6.4.12.1.5 受限证券类别：资产支持证券											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注	

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

于 2019 年 6 月 30 日，本基金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，本基金未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 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。

本基金的基金管理人建立了以合规与风险控制委员会为核心的，由总经理、风险控制委员会、

督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向合规与风险控制委员会提交独立的监察稽核报告和建议；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责。

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。

#### 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交通银行，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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 4 月 23 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	200,260.00
未评级	2,829,075.00	-

合计	2,829,075.00	200,260.00
----	--------------	------------

注：本基金期末持有未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年4月23日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	2,621,484.00
合计	-	2,621,484.00

注：本基金于本期末未持有短期同业存单投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

#### 6.4.13.3 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府债的合同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（所有者权益）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。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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。

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。

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（所有者权益）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。

### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

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。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2019 年 4 月 23 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	688,719.85	-	-	-	-	-	688,719.85
结算备付金	602,455.90	-	-	-	-	-	602,455.90
存出保证金	32,399.19	-	-	-	-	-	32,399.19
交易性金融资产	-	-	-2,829,075.00	-	-	-51,703,029.11	54,532,104.11
应收利息	-	-	-	-	-	56,409.28	56,409.28
应收申购款	-	-	-	-	-	3,404.89	3,404.89
资产总计	1,323,574.94	-	-2,829,075.00	-	-	-51,762,843.28	55,915,493.22
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,430.39	1,430.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,036.58	18,036.58
应付托管费	-	-	-	-	-	3,607.30	3,607.30
应付交易费用	-	-	-	-	-	54,957.11	54,957.11
其他负债	-	-	-	-	-	191,394.58	191,394.58
负债总计	-	-	-	-	-	269,425.96	269,425.96
利率敏感度缺口	1,323,574.94	-	-2,829,075.00	-	-	-51,493,417.32	55,646,067.26
上年度末 2018 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	731,868.72	-	-	-	-	-	731,868.72
结算备付金	290,747.95	-	-	-	-	-	290,747.95
存出保证金	19,774.95	-	-	-	-	-	19,774.95
交易性金融资产	-	-	-2,821,744.00	-	-	-47,501,601.59	50,323,345.59
应收利息	-	-	-	-	-	75,326.09	75,326.09
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,042,391.62	-	-2,821,744.00	-	-	-47,576,927.68	51,441,063.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	717.12	717.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,275.00	22,275.00
应付托管费	-	-	-	-	-	4,454.99	4,454.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	263,503.10	263,503.10
其他负债	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	440,950.21	440,950.21
利率敏感度缺口	1,042,391.62	-	-2,821,744.00	-	-	-47,135,977.47	51,000,113.09

**6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	-		
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（2019 年 4 月 23 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-2,442.91	-2,037.46
	市场利率下降 25 个基点	2,442.91	2,037.46

**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，因此无重大外汇风险。

**6.4.13.4.3 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债券，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。

本基金采用定量分析和定性分析相结合的方法，深入研究我国经济周期当前所处阶段(复苏、扩张、滞胀和衰退)及未来发展方向，确定不同经济周期阶段下的资产配置和行业投资策略，在有效控制风险的前提下，精选优质上市公司股票构建投资组合，力求获得较高的投资收益。

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。

**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	上年度末
----	-----	------

	2019 年 4 月 23 日		2018 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	51,703,029.11	92.91	47,501,601.59	93.14
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	2,829,075.00	5.08	2,821,744.00	5.53
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	54,532,104.11	98.00	50,323,345.59	98.67

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 (2019 年 4 月 23 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
		沪深 300 上升 5%	2,513,829.25
沪深 300 下降 5%	-2,513,829.25	-2,187,557.40	

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。

#### 6.4.14 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（转型后）

### 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	47,937,644.37	93.19
	其中：股票	47,937,644.37	93.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,516,509.00	4.89
	其中：债券	2,516,509.00	4.89
	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	897,701.40	1.75
8	其他各项资产	87,036.34	0.17
9	合计	51,438,891.11	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资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	1,166,281.00	2.28
B	采矿业	853,858.42	1.67
C	制造业	23,631,690.96	46.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,255,345.45	2.45
E	建筑业	828,546.00	1.62
F	批发和零售业	2,275,499.10	4.45
G	交通运输、仓储和邮政业	1,579,721.00	3.09
H	住宿和餐饮业	226,712.64	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,166,324.21	10.10
J	金融业	1,612,034.60	3.15
K	房地产业	2,603,742.78	5.09
L	租赁和商务服务业	982,505.41	1.92

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	603,692.19	1.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	25,976.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	440,910.00	0.86
S	综合	1,066,559.00	2.08
	合计	44,319,398.76	86.64

### 7.2.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	39,227.88	0.08
B	采矿业	33,966.40	0.07
C	制造业	2,557,979.46	5.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	73,060.12	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,158.96	0.05
J	金融业	128,377.79	0.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	601,380.00	1.18
R	文化、体育和娱乐业	160,095.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	3,618,245.61	7.07

### 7.2.1 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。

### 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

#### 7.3.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例（%）
1	002463	沪电股份	71,500	973,830.00	1.90
2	603369	今世缘	27,870	777,294.30	1.52
3	603228	景旺电子	19,160	766,591.60	1.50
4	000732	泰禾集团	44,600	735,900.00	1.44
5	000878	云南铜业	67,800	720,714.00	1.41
6	603806	福斯特	19,400	712,562.00	1.39
7	002399	海普瑞	33,700	707,363.00	1.38
8	601100	恒立液压	22,500	706,050.00	1.38
9	600282	南钢股份	201,300	704,550.00	1.38
10	600026	中远海能	107,800	699,622.00	1.37
11	002195	二三四五	179,439	698,017.71	1.36
12	600039	四川路桥	191,700	697,788.00	1.36
13	601717	郑煤机	121,924	696,186.04	1.36
14	600643	爱建集团	72,500	694,550.00	1.36
15	002635	安洁科技	51,100	689,339.00	1.35
16	600167	联美控股	64,670	684,208.60	1.34
17	600037	歌华有线	66,500	681,625.00	1.33
18	600633	浙数文化	72,900	681,615.00	1.33
19	600266	北京城建	84,480	680,908.80	1.33
20	002152	广电运通	99,200	679,520.00	1.33
21	600611	大众交通	142,000	660,300.00	1.29
22	600978	宜华生活	174,800	657,248.00	1.28
23	600064	南京高科	61,330	656,844.30	1.28
24	600673	东阳光	82,600	648,410.00	1.27
25	002299	圣农发展	25,000	633,000.00	1.24
26	600967	内蒙一机	56,400	631,680.00	1.23
27	603568	伟明环保	27,990	602,344.80	1.18
28	600881	亚泰集团	183,838	597,473.50	1.17
29	000999	华润三九	20,200	592,668.00	1.16
30	002028	思源电气	57,000	567,720.00	1.11
31	300418	昆仑万维	43,500	559,845.00	1.09
32	002221	东华能源	65,000	559,650.00	1.09
33	600426	华鲁恒升	36,200	537,932.00	1.05

34	600598	北大荒	49,700	533,281.00	1.04
35	000061	农产品	96,500	523,030.00	1.02
36	603556	海兴电力	37,800	522,396.00	1.02
37	600699	均胜电子	22,900	489,144.00	0.96
38	600335	国机汽车	69,000	477,480.00	0.93
39	300383	光环新网	27,700	464,529.00	0.91
40	600466	蓝光发展	72,700	452,194.00	0.88
41	002250	联化科技	40,500	449,145.00	0.88
42	000975	银泰资源	33,903	447,180.57	0.87
43	002251	步步高	55,500	442,335.00	0.86
44	002408	齐翔腾达	56,900	440,975.00	0.86
45	002074	国轩高科	32,000	419,520.00	0.82
46	603712	七一二	19,700	418,231.00	0.82
47	600410	华胜天成	38,100	408,813.00	0.80
48	600062	华润双鹤	32,240	406,546.40	0.79
49	300182	捷成股份	91,900	405,279.00	0.79
50	603444	吉比特	1,900	398,924.00	0.78
51	300253	卫宁健康	28,100	398,458.00	0.78
52	000807	云铝股份	83,800	393,022.00	0.77
53	603328	依顿电子	38,000	390,260.00	0.76
54	600862	中航高科	43,200	388,368.00	0.76
55	002128	露天煤业	43,400	375,410.00	0.73
56	002038	双鹭药业	15,900	374,604.00	0.73
57	000623	吉林敖东	22,800	373,692.00	0.73
58	600053	九鼎投资	15,700	365,810.00	0.72
59	600312	平高电气	47,402	364,521.38	0.71
60	600260	凯乐科技	18,000	359,640.00	0.70
61	002110	三钢闽光	38,450	357,585.00	0.70
62	000543	皖能电力	74,900	352,779.00	0.69
63	000009	中国宝安	56,700	323,757.00	0.63
64	002489	浙江永强	93,800	313,292.00	0.61
65	600908	无锡银行	54,400	306,816.00	0.60
66	600648	外高桥	14,600	306,308.00	0.60
67	300010	立思辰	32,600	306,114.00	0.60
68	300168	万达信息	22,500	291,825.00	0.57
69	000513	丽珠集团	8,700	289,101.00	0.57
70	600993	马应龙	15,600	275,340.00	0.54
71	600782	新钢股份	53,700	268,500.00	0.52
72	002818	富森美	20,760	266,350.80	0.52

73	002745	木林森	22,100	259,012.00	0.51
74	600315	上海家化	8,300	258,545.00	0.51
75	600779	水井坊	4,800	243,936.00	0.48
76	000723	美锦能源	23,300	243,485.00	0.48
77	002049	紫光国微	5,300	233,783.00	0.46
78	600754	锦江股份	9,201	226,712.64	0.44
79	002092	中泰化学	27,800	221,288.00	0.43
80	601872	招商轮船	50,400	219,744.00	0.43
81	002681	奋达科技	48,100	203,944.00	0.40
82	600737	中粮糖业	23,100	200,508.00	0.39
83	600801	华新水泥	9,520	192,780.00	0.38
84	000877	天山股份	15,900	184,758.00	0.36
85	300134	大富科技	11,700	181,701.00	0.36
86	603225	新风鸣	13,956	174,310.44	0.34
87	000686	东北证券	19,700	173,557.00	0.34
88	002048	宁波华翔	15,800	170,956.00	0.33
89	002273	水晶光电	14,200	164,436.00	0.32
90	000997	新大陆	9,000	152,010.00	0.30
91	600859	王府井	10,000	151,900.00	0.30
92	600418	江淮汽车	29,400	151,704.00	0.30
93	000685	中山公用	17,600	150,304.00	0.29
94	300115	长盈精密	14,300	150,007.00	0.29
95	002127	南极电商	13,200	148,368.00	0.29
96	002242	九阳股份	6,600	137,346.00	0.27
97	002440	闰土股份	10,900	135,814.00	0.27
98	002051	中工国际	11,400	130,758.00	0.26
99	002366	台海核电	13,300	124,488.00	0.24
100	600171	上海贝岭	6,800	110,500.00	0.22
101	603025	大豪科技	10,728	109,854.72	0.21
102	002191	劲嘉股份	8,800	109,208.00	0.21
103	002916	深南电路	1,060	108,035.20	0.21
104	603355	莱克电气	4,900	105,448.00	0.21
105	000547	航天发展	10,200	97,512.00	0.19
106	002665	首航节能	28,100	95,259.00	0.19
107	600895	张江高科	4,600	94,392.00	0.18
108	600409	三友化工	15,000	84,900.00	0.17
109	600875	东方电气	7,600	80,712.00	0.16
110	600525	长园集团	12,221	77,236.72	0.15
111	600639	浦东金桥	4,300	69,531.00	0.14

112	002517	恺英网络	21,600	68,904.00	0.13
113	000600	建投能源	10,000	67,000.00	0.13
114	600751	海航科技	19,300	61,374.00	0.12
115	000563	陕国投 A	13,200	58,608.00	0.11
116	603868	飞科电器	1,400	54,810.00	0.11
117	600623	华谊集团	6,900	52,716.00	0.10
118	603816	顾家家居	1,640	52,348.80	0.10
119	603888	新华网	2,500	49,900.00	0.10
120	600277	亿利洁能	8,600	41,882.00	0.08
121	601168	西部矿业	4,900	31,262.00	0.06
122	601311	骆驼股份	2,700	29,295.00	0.06
123	603377	东方时尚	1,700	25,976.00	0.05
124	600884	杉杉股份	2,400	25,560.00	0.05
125	300058	蓝色光标	5,900	25,193.00	0.05
126	000681	视觉中国	1,100	21,318.00	0.04
127	002707	众信旅游	3,223	19,563.61	0.04
128	000156	华数传媒	1,300	14,313.00	0.03
129	002670	国盛金控	1,000	12,600.00	0.02
130	002437	誉衡药业	2,600	10,270.00	0.02
131	600657	信达地产	2,000	8,240.00	0.02
132	300274	阳光电源	600	5,610.00	0.01
133	002373	千方科技	300	5,130.00	0.01
134	600126	杭钢股份	1,000	4,560.00	0.01
135	000860	顺鑫农业	40	1,866.00	0.00
136	601200	上海环境	99	1,347.39	0.00
137	000025	特力 A	55	1,112.10	0.00
138	600021	上海电力	80	694.40	0.00
139	600750	江中药业	50	650.50	0.00
140	300166	东方国信	50	614.50	0.00
141	600195	中牧股份	40	554.00	0.00
142	600885	宏发股份	20	486.00	0.00
143	000541	佛山照明	90	471.60	0.00
144	600141	兴发集团	40	411.20	0.00
145	300159	新研股份	75	373.50	0.00
146	000598	兴蓉环境	79	359.45	0.00
147	600201	生物股份	20	313.80	0.00
148	600160	巨化股份	40	284.40	0.00
149	000488	晨鸣纸业	50	268.00	0.00
150	000006	深振业 A	21	114.45	0.00

151	000012	南 玻 A	27	112.32	0.00
152	002807	江阴银行	20	93.60	0.00
153	600183	生益科技	5	75.25	0.00
154	601000	唐山港	20	55.00	0.00
155	002233	塔牌集团	1	11.68	0.00
156	002672	东江环保	1	11.34	0.00
157	600158	中体产业	1	10.23	0.00
158	600765	中航重机	1	9.23	0.00
159	600869	智慧能源	2	9.04	0.00
160	600971	恒源煤电	1	5.85	0.00

### 7.3.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例（%）
1	000596	古井贡酒	5,700	675,507.00	1.32
2	300146	汤臣倍健	33,000	640,200.00	1.25
3	300347	泰格医药	7,800	601,380.00	1.18
4	603658	安图生物	7,200	492,192.00	0.96
5	002563	森马服饰	18,100	200,186.00	0.39
6	000333	美的集团	3,800	197,068.00	0.39
7	002308	威创股份	38,500	191,730.00	0.37
8	300413	芒果超媒	3,900	160,095.00	0.31
9	601688	华泰证券	4,000	89,280.00	0.17
10	601298	青岛港	8,708	73,060.12	0.14
11	600618	氯碱化工	6,000	47,160.00	0.09
12	300761	立华股份	732	39,227.88	0.08
13	300782	卓胜微	347	37,795.24	0.07
14	600968	海油发展	9,568	33,966.40	0.07
15	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.07
16	603867	新化股份	1,010	26,068.10	0.05
17	601698	中国卫通	6,163	24,158.96	0.05
18	300594	朗进科技	451	19,893.61	0.04
19	000969	安泰科技	2,300	19,412.00	0.04
20	603863	松炆资源	411	9,485.88	0.02
21	601336	新华保险	95	5,227.85	0.01
22	600176	中国巨石	83	790.99	0.00
23	300433	蓝思科技	49	341.53	0.00

24	600184	光电股份	13	149.11	0.00
----	--------	------	----	--------	------

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600633	浙数文化	698,792.00	1.37
2	300146	汤臣倍健	690,673.00	1.35
3	000878	云南铜业	683,039.00	1.34
4	600282	南钢股份	679,310.00	1.33
5	000732	泰禾集团	667,186.00	1.30
6	603228	景旺电子	656,794.00	1.28
7	002152	广电运通	640,938.00	1.25
8	600673	东阳光	607,484.00	1.19
9	600967	内蒙一机	600,594.00	1.17
10	000999	华润三九	589,422.00	1.15
11	002635	安洁科技	578,741.00	1.13
12	002221	东华能源	555,437.00	1.09
13	600881	亚泰集团	552,492.68	1.08
14	600064	南京高科	551,366.00	1.08
15	600978	宜华生活	544,371.00	1.06
16	600037	歌华有线	521,196.00	1.02
17	002028	思源电气	517,301.00	1.01
18	600026	中远海能	488,616.00	0.96
19	002195	二三四五	485,594.00	0.95
20	603369	今世缘	477,799.10	0.93

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600008	首创股份	671,582.00	1.31
2	601003	柳钢股份	554,847.00	1.08
3	600804	鹏博士	494,561.00	0.97
4	600884	杉杉股份	467,773.00	0.91

5	002233	塔牌集团	460,195.00	0.90
6	000090	天健集团	454,132.00	0.89
7	600820	隧道股份	451,162.43	0.88
8	600201	生物股份	439,773.00	0.86
9	000006	深振业 A	435,924.00	0.85
10	002507	涪陵榨菜	420,768.00	0.82
11	600657	信达地产	419,895.00	0.82
12	000960	锡业股份	416,013.40	0.81
13	300459	金科文化	412,028.00	0.81
14	600811	东方集团	404,424.00	0.79
15	601928	凤凰传媒	396,325.00	0.77
16	002439	启明星辰	379,347.00	0.74
17	002345	潮宏基	368,490.00	0.72
18	600567	山鹰纸业	368,380.00	0.72
19	600316	洪都航空	367,200.00	0.72
20	000581	威孚高科	366,825.00	0.72

### 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	41,015,678.40
卖出股票收入（成交）总额	40,148,048.06

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,516,509.00	4.92
	其中：政策性金融债	2,516,509.00	4.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,516,509.00	4.92

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108603	国开 1804	25,150	2,516,509.00	4.92

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受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。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,555.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	63,471.17
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,036.34

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	---------------	----------

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.07	新股锁定

#### 7.12.6 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。

## § 7 投资组合报告（转型前）

### 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	51,703,029.11	92.47
	其中：股票	51,703,029.11	92.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,829,075.00	5.06
	其中：债券	2,829,075.00	5.06
	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	1,291,175.75	2.31
8	其他资产	92,213.36	0.16
9	合计	55,915,493.22	100.00

### 7.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	494,558.00	0.89
B	采矿业	2,259,944.03	4.06
C	制造业	27,904,279.42	50.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,575,685.30	2.83
E	建筑业	1,431,468.00	2.57
F	批发和零售业	2,376,358.00	4.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,923,690.80	3.46
H	住宿和餐饮业	296,836.85	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,226,551.80	9.39
J	金融业	2,276,949.65	4.09
K	房地产业	2,679,042.95	4.81
L	租赁和商务服务业	981,298.99	1.76
M	科学研究和技术服务业	83,574.40	0.15

N	水利、环境和公共设施管理业	389,808.92	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	373,824.00	0.67
R	文化、体育和娱乐业	1,186,668.00	2.13
S	综合	242,490.00	0.44
	合计	51,703,029.11	92.91

### 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。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	600782	新钢股份	120,600	774,252.00	1.39
2	600008	首创股份	186,200	767,144.00	1.38
3	601717	郑煤机	119,924	754,321.96	1.36
4	002038	双鹭药业	26,300	714,045.00	1.28
5	601003	柳钢股份	87,100	641,927.00	1.15
6	600884	杉杉股份	41,200	624,592.00	1.12
7	600779	水井坊	12,700	589,280.00	1.06
8	002092	中泰化学	56,600	561,472.00	1.01
9	000975	银泰资源	52,203	529,338.42	0.95
10	600820	隧道股份	71,000	517,590.00	0.93
11	600657	信达地产	99,400	514,892.00	0.93
12	000090	天健集团	68,600	509,698.00	0.92
13	000006	深振业A	77,621	500,655.45	0.90
14	002233	塔牌集团	40,601	479,497.81	0.86
15	000960	锡业股份	38,100	470,535.00	0.85
16	600811	东方集团	109,600	464,704.00	0.84
17	002439	启明星辰	15,700	448,392.00	0.81
18	002507	涪陵榨菜	15,500	443,145.00	0.80
19	603806	福斯特	12,300	440,955.00	0.79
20	603658	安图生物	7,200	437,760.00	0.79
21	300459	金科文化	48,600	435,942.00	0.78
22	600201	生物股份	27,620	429,767.20	0.77
23	600643	爱建集团	36,600	429,318.00	0.77

24	600316	洪都航空	27,000	428,760.00	0.77
25	600623	华谊集团	43,300	426,072.00	0.77
26	601928	凤凰传媒	50,500	425,210.00	0.76
27	600567	山鹰纸业	108,700	416,321.00	0.75
28	002299	圣农发展	14,700	411,894.00	0.74
29	600611	大众交通	82,400	411,176.00	0.74
30	002399	海普瑞	16,000	398,560.00	0.72
31	002129	中环股份	36,800	394,864.00	0.71
32	600971	恒源煤电	45,801	394,346.61	0.71
33	000750	国海证券	66,000	389,400.00	0.70
34	603568	伟明环保	14,400	388,656.00	0.70
35	002463	沪电股份	31,400	388,418.00	0.70
36	300166	东方国信	27,150	387,430.50	0.70
37	600039	四川路桥	95,500	380,090.00	0.68
38	300347	泰格医药	5,900	373,824.00	0.67
39	600266	北京城建	32,900	337,225.00	0.61
40	002127	南极电商	29,400	336,042.00	0.60
41	600743	华远地产	109,700	335,682.00	0.60
42	000596	古井贡酒	3,000	332,490.00	0.60
43	002049	紫光国微	7,800	331,344.00	0.60
44	002074	国轩高科	21,300	329,085.00	0.59
45	300274	阳光电源	25,300	325,864.00	0.59
46	603816	顾家家居	6,000	321,660.00	0.58
47	000930	中粮生化	35,500	321,275.00	0.58
48	002690	美亚光电	12,300	320,415.00	0.58
49	600143	金发科技	57,600	316,224.00	0.57
50	600639	浦东金桥	18,800	314,336.00	0.56
51	002344	海宁皮城	56,900	313,519.00	0.56
52	000008	神州高铁	66,200	309,154.00	0.56
53	600021	上海电力	33,380	306,762.20	0.55
54	002004	华邦健康	53,800	305,584.00	0.55
55	002410	广联达	11,300	305,439.00	0.55
56	600511	国药股份	11,400	305,406.00	0.55
57	002174	游族网络	14,000	300,720.00	0.54
58	300088	长信科技	48,500	295,365.00	0.53
59	600827	百联股份	28,900	295,069.00	0.53
60	002839	张家港行	43,000	293,260.00	0.53
61	600160	巨化股份	31,840	289,107.20	0.52
62	002359	北讯集团	26,200	286,104.00	0.51

63	601168	西部矿业	45,800	285,792.00	0.51
64	000723	美锦能源	15,700	282,600.00	0.51
65	601100	恒立液压	8,600	267,804.00	0.48
66	600312	平高电气	32,000	262,400.00	0.47
67	300413	芒果超媒	5,800	252,880.00	0.45
68	000887	中鼎股份	20,700	250,056.00	0.45
69	600801	华新水泥	9,100	249,431.00	0.45
70	002373	千方科技	13,200	249,348.00	0.45
71	600525	长园集团	34,921	248,637.52	0.45
72	603328	依顿电子	22,500	248,400.00	0.45
73	002195	二三四五	43,730	248,386.40	0.45
74	600426	华鲁恒升	15,600	248,040.00	0.45
75	002353	杰瑞股份	9,600	247,680.00	0.45
76	600258	首旅酒店	11,500	243,110.00	0.44
77	600167	联美控股	18,900	242,865.00	0.44
78	000025	特力A	6,900	238,533.00	0.43
79	603369	今世缘	8,600	233,662.00	0.42
80	600350	山东高速	46,200	231,462.00	0.42
81	002408	齐翔腾达	23,400	229,320.00	0.41
82	300253	卫宁健康	16,400	228,944.00	0.41
83	300418	昆仑万维	15,100	227,708.00	0.41
84	000547	航天发展	20,600	227,218.00	0.41
85	000813	德展健康	19,700	225,762.00	0.41
86	300383	光环新网	12,900	225,363.00	0.40
87	002368	太极股份	6,400	221,760.00	0.40
88	603000	人民网	8,500	219,640.00	0.39
89	600565	迪马股份	45,500	218,855.00	0.39
90	601000	唐山港	70,520	218,612.00	0.39
91	600699	均胜电子	8,000	218,400.00	0.39
92	000426	兴业矿业	36,100	215,878.00	0.39
93	600804	鹏博士	19,200	215,808.00	0.39
94	300316	晶盛机电	16,200	214,974.00	0.39
95	600536	中国软件	3,900	214,500.00	0.39
96	600329	中新药业	12,900	212,721.00	0.38
97	600026	中远海能	30,800	210,672.00	0.38
98	600787	中储股份	30,700	209,988.00	0.38
99	600053	九鼎投资	8,100	208,413.00	0.37
100	002465	海格通信	21,000	207,060.00	0.37
101	002371	北方华创	3,200	204,704.00	0.37

102	000623	吉林敖东	10,800	203,688.00	0.37
103	002583	海能达	17,600	198,176.00	0.36
104	600872	中炬高新	5,700	197,049.00	0.35
105	000418	小天鹅 A	3,400	196,792.00	0.35
106	002563	森马服饰	17,900	196,005.00	0.35
107	600584	长电科技	13,700	189,608.00	0.34
108	300058	蓝色光标	36,000	186,840.00	0.34
109	000860	顺鑫农业	3,100	186,279.00	0.33
110	600256	广汇能源	41,100	186,183.00	0.33
111	603885	吉祥航空	13,600	185,504.00	0.33
112	600655	豫园股份	18,900	185,031.00	0.33
113	600859	王府井	10,000	183,900.00	0.33
114	600037	歌华有线	15,600	183,612.00	0.33
115	600572	康恩贝	20,200	183,416.00	0.33
116	601866	中远海发	54,600	181,272.00	0.33
117	600338	西藏珠峰	6,400	178,624.00	0.32
118	300182	捷成股份	30,400	177,840.00	0.32
119	002110	三钢闽光	9,400	177,284.00	0.32
120	601966	玲珑轮胎	9,800	175,518.00	0.32
121	600291	西水股份	12,100	175,450.00	0.32
122	603444	吉比特	800	175,232.00	0.31
123	601179	中国西电	40,000	174,000.00	0.31
124	600478	科力远	26,400	173,448.00	0.31
125	002273	水晶光电	12,900	173,118.00	0.31
126	000021	深科技	20,100	172,257.00	0.31
127	300199	翰宇药业	15,600	170,352.00	0.31
128	002440	闰土股份	9,500	165,870.00	0.30
129	600060	海信电器	15,600	165,672.00	0.30
130	000877	天山股份	13,900	162,630.00	0.29
131	002244	滨江集团	33,100	161,859.00	0.29
132	600895	张江高科	6,700	159,594.00	0.29
133	002013	中航机电	20,500	159,490.00	0.29
134	000049	德赛电池	4,700	158,719.00	0.29
135	600618	氯碱化工	16,400	158,424.00	0.28
136	002308	威创股份	26,000	157,560.00	0.28
137	600765	中航重机	14,501	154,435.65	0.28
138	000987	越秀金控	12,600	153,090.00	0.28
139	300308	中际旭创	2,800	152,320.00	0.27
140	600978	宜华生活	30,500	149,145.00	0.27

141	600759	洲际油气	29,300	149,137.00	0.27
142	603712	七一二	6,600	143,550.00	0.26
143	002281	光迅科技	4,500	140,265.00	0.25
144	601128	常熟银行	17,300	139,611.00	0.25
145	002155	湖南黄金	16,900	137,904.00	0.25
146	603198	迎驾贡酒	7,600	135,432.00	0.24
147	600614	鹏起科技	20,300	134,183.00	0.24
148	002807	江阴银行	25,320	133,942.80	0.24
149	002831	裕同科技	2,500	131,875.00	0.24
150	000758	中色股份	25,500	129,795.00	0.23
151	300315	掌趣科技	30,500	129,320.00	0.23
152	603556	海兴电力	8,640	128,736.00	0.23
153	600179	安通控股	14,700	125,832.00	0.23
154	600563	法拉电子	2,800	124,376.00	0.22
155	300324	旋极信息	16,600	123,504.00	0.22
156	000686	东北证券	11,700	121,914.00	0.22
157	600064	南京高科	10,230	121,020.90	0.22
158	000028	国药一致	2,500	119,650.00	0.22
159	603877	太平鸟	5,800	117,740.00	0.21
160	300159	新研股份	19,875	117,063.75	0.21
161	603766	隆鑫通用	22,500	115,650.00	0.21
162	600718	东软集团	8,000	113,360.00	0.20
163	601811	新华文轩	8,100	112,671.00	0.20
164	000690	宝新能源	14,200	111,470.00	0.20
165	002635	安洁科技	7,300	110,376.00	0.20
166	002437	誉衡药业	22,900	109,233.00	0.20
167	300002	神州泰岳	22,600	108,706.00	0.20
168	600410	华胜天成	12,300	108,117.00	0.19
169	603515	欧普照明	3,000	105,780.00	0.19
170	002242	九阳股份	4,700	105,092.00	0.19
171	002589	瑞康医药	13,000	104,390.00	0.19
172	002191	劲嘉股份	7,200	103,104.00	0.19
173	002745	木林森	7,400	101,676.00	0.18
174	002424	贵州百灵	8,600	101,308.00	0.18
175	000027	深圳能源	15,500	97,185.00	0.17
176	002028	思源电气	7,400	94,794.00	0.17
177	600315	上海家化	3,100	91,419.00	0.16
178	600557	康缘药业	6,400	89,216.00	0.16
179	000990	诚志股份	3,600	88,272.00	0.16

180	600862	中航高科	8,900	87,754.00	0.16
181	002345	潮宏基	17,200	87,548.00	0.16
182	601298	青岛港	8,708	87,254.16	0.16
183	600195	中牧股份	6,440	86,360.40	0.16
184	601688	华泰证券	4,000	85,720.00	0.15
185	000061	农产品	14,000	85,260.00	0.15
186	002916	深南电路	700	84,854.00	0.15
187	603883	老百姓	1,500	84,660.00	0.15
188	000513	丽珠集团	2,500	83,250.00	0.15
189	600673	东阳光	8,800	82,896.00	0.15
190	600839	四川长虹	23,300	81,783.00	0.15
191	002002	鸿达兴业	11,700	80,613.00	0.14
192	300450	先导智能	2,300	80,385.00	0.14
193	000738	航发控制	5,400	80,352.00	0.14
194	600280	中央商场	17,100	80,199.00	0.14
195	600298	安琪酵母	2,900	79,460.00	0.14
196	000587	金洲慈航	24,200	78,650.00	0.14
197	600755	厦门国贸	8,500	77,095.00	0.14
198	002250	联化科技	7,000	76,930.00	0.14
199	300113	顺网科技	3,600	74,592.00	0.13
200	300133	华策影视	9,200	74,152.00	0.13
201	002332	仙琚制药	9,500	73,910.00	0.13
202	600335	国机汽车	9,200	73,876.00	0.13
203	600885	宏发股份	2,820	73,122.60	0.13
204	002385	大北农	9,300	72,912.00	0.13
205	002372	伟星新材	3,800	71,820.00	0.13
206	002358	森源电气	5,100	70,431.00	0.13
207	300010	立思辰	6,600	69,762.00	0.13
208	300168	万达信息	4,200	65,436.00	0.12
209	600528	中铁工业	5,100	64,974.00	0.12
210	002317	众生药业	6,400	64,192.00	0.12
211	600750	江中药业	3,440	62,745.60	0.11
212	600881	亚泰集团	15,800	62,410.00	0.11
213	002048	宁波华翔	4,700	62,040.00	0.11
214	000766	通化金马	6,200	61,504.00	0.11
215	600155	华创阳安	3,900	60,762.00	0.11
216	002818	富森美	2,300	59,616.00	0.11
217	002414	高德红外	2,200	59,268.00	0.11
218	002266	浙富控股	10,500	58,065.00	0.10

219	000732	泰禾集团	3,100	57,753.00	0.10
220	600094	大名城	5,700	56,943.00	0.10
221	002951	金时科技	1,675	54,437.50	0.10
222	603228	景旺电子	900	54,315.00	0.10
223	600754	锦江股份	2,001	53,726.85	0.10
224	601020	华钰矿业	4,600	52,946.00	0.10
225	300287	飞利信	10,900	52,756.00	0.09
226	300761	立华股份	732	52,521.00	0.09
227	002588	史丹利	9,600	51,936.00	0.09
228	002221	东华能源	4,300	51,342.00	0.09
229	002640	跨境通	4,100	51,291.00	0.09
230	002249	大洋电机	7,700	51,282.00	0.09
231	002517	恺英网络	11,800	50,976.00	0.09
232	002815	崇达技术	3,000	50,280.00	0.09
233	601801	皖新传媒	6,800	49,980.00	0.09
234	601608	中信重工	9,400	49,256.00	0.09
235	002950	奥美医疗	1,575	49,218.75	0.09
236	300297	蓝盾股份	6,300	49,014.00	0.09
237	300134	大富科技	2,900	47,792.00	0.09
238	002354	天神娱乐	8,300	46,729.00	0.08
239	000536	华映科技	14,000	46,620.00	0.08
240	601326	秦港股份	10,800	45,036.00	0.08
241	002030	达安基因	3,600	44,964.00	0.08
242	002949	华阳国际	1,580	43,655.40	0.08
243	002642	荣之联	6,800	43,384.00	0.08
244	000563	陕国投 A	8,200	43,296.00	0.08
245	600409	三友化工	5,500	41,305.00	0.07
246	603068	博通集成	861	40,923.33	0.07
247	601231	环旭电子	2,800	39,956.00	0.07
248	600645	中源协和	1,900	39,919.00	0.07
249	000156	华数传媒	3,200	39,520.00	0.07
250	000600	建投能源	5,200	39,312.00	0.07
251	600901	江苏租赁	5,100	36,975.00	0.07
252	603317	天味食品	1,156	36,090.32	0.06
253	600158	中体产业	3,101	35,971.60	0.06
254	000830	鲁西化工	2,300	34,776.00	0.06
255	002681	奋达科技	6,600	34,386.00	0.06
256	603233	大参林	700	32,788.00	0.06
257	002444	巨星科技	2,700	32,130.00	0.06

258	300770	新媒股份	502	31,636.04	0.06
259	002041	登海种业	4,300	30,143.00	0.05
260	600751	海航科技	7,600	28,424.00	0.05
261	002426	胜利精密	8,400	28,224.00	0.05
262	000612	焦作万方	5,300	26,076.00	0.05
263	600260	凯乐科技	1,100	24,673.00	0.04
264	002118	紫鑫药业	1,700	24,242.00	0.04
265	600240	华业资本	7,500	23,850.00	0.04
266	601311	骆驼股份	1,800	23,688.00	0.04
267	000681	视觉中国	1,000	22,790.00	0.04
268	300768	迪普科技	662	20,872.86	0.04
269	600737	中粮糖业	1,900	19,969.00	0.04
270	600664	哈药股份	3,500	18,585.00	0.03
271	600373	中文传媒	1,300	18,265.00	0.03
272	603967	中创物流	1,102	16,882.64	0.03
273	000066	中国长城	1,500	13,740.00	0.02
274	300772	运达股份	2,079	13,555.08	0.02
275	002699	美盛文化	1,600	13,360.00	0.02
276	002663	普邦股份	3,500	13,020.00	0.02
277	000729	燕京啤酒	1,600	11,808.00	0.02
278	002482	广田集团	1,800	11,070.00	0.02
279	000543	皖能电力	2,000	10,560.00	0.02
280	300202	聚龙股份	1,000	8,230.00	0.01
281	300001	特锐德	400	8,132.00	0.01
282	002390	信邦制药	900	5,877.00	0.01
283	601336	新华保险	95	5,797.85	0.01
284	601200	上海环境	76	1,152.92	0.00
285	600176	中国巨石	83	916.32	0.00
286	603225	新凤鸣	56	813.68	0.00
287	600062	华润双鹤	40	558.80	0.00
288	000541	佛山照明	90	556.20	0.00
289	600141	兴发集团	40	492.80	0.00
290	300433	蓝思科技	49	444.92	0.00
291	000598	兴蓉环境	79	387.10	0.00
292	600392	盛和资源	30	341.70	0.00
293	603025	大豪科技	28	330.12	0.00
294	000488	晨鸣纸业	50	315.50	0.00
295	600184	光电股份	13	164.45	0.00
296	000012	南玻 A	25	131.75	0.00

297	600183	生益科技	5	69.00	0.00
298	002707	众信旅游	3	21.99	0.00
299	002672	东江环保	1	12.51	0.00
300	600869	智慧能源	2	11.00	0.00

## 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	000600	建投能源	1,849,624.00	3.63
2	002004	华邦健康	1,610,499.00	3.16
3	300166	东方国信	1,484,317.00	2.91
4	600557	康缘药业	1,449,190.00	2.84
5	600266	北京城建	1,313,452.00	2.58
6	600939	重庆建工	1,286,970.00	2.52
7	601717	郑煤机	1,268,618.00	2.49
8	600779	水井坊	1,261,191.00	2.47
9	000975	银泰资源	1,249,082.00	2.45
10	002818	富森美	1,243,749.00	2.44
11	002359	北讯集团	1,239,441.00	2.43
12	002128	露天煤业	1,222,357.00	2.40
13	000006	深振业 A	1,198,930.76	2.35
14	603369	今世缘	1,171,208.00	2.30
15	600155	华创阳安	1,139,869.21	2.24
16	600338	西藏珠峰	1,135,567.00	2.23
17	600618	氯碱化工	1,123,342.73	2.20
18	002690	美亚光电	1,119,602.00	2.20
19	002344	海宁皮城	1,102,470.00	2.16
20	300324	旋极信息	1,082,109.00	2.12
21	000623	吉林敖东	1,071,245.00	2.10
22	600971	恒源煤电	1,061,066.00	2.08
23	600859	王府井	1,054,350.00	2.07
24	600478	科力远	1,035,536.00	2.03
25	000930	中粮生化	1,035,020.00	2.03

## 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	002152	广电运通	2,114,080.00	4.15
2	000623	吉林敖东	2,081,996.00	4.08
3	000600	建投能源	2,081,687.00	4.08
4	603766	隆鑫通用	1,952,427.00	3.83
5	600426	华鲁恒升	1,891,065.00	3.71
6	000021	深科技	1,870,136.00	3.67
7	601928	凤凰传媒	1,777,778.00	3.49
8	603328	依顿电子	1,693,569.00	3.32
9	000975	银泰资源	1,692,297.00	3.32
10	600478	科力远	1,638,109.00	3.21
11	002344	海宁皮城	1,628,020.00	3.19
12	600859	王府井	1,590,208.00	3.12
13	000598	兴蓉环境	1,555,406.00	3.05
14	002195	二三四五	1,533,611.00	3.01
15	600970	中材国际	1,512,561.00	2.97
16	002818	富森美	1,501,393.26	2.94
17	600557	康缘药业	1,493,095.00	2.93
18	300088	长信科技	1,453,323.00	2.85
19	600823	世茂股份	1,448,636.00	2.84
20	002254	泰和新材	1,445,026.00	2.83
21	600155	华创阳安	1,428,444.00	2.80
22	000930	中粮生化	1,421,698.00	2.79
23	603888	新华网	1,412,907.00	2.77
24	002004	华邦健康	1,404,319.00	2.75
25	600673	东阳光	1,381,211.00	2.71
26	000656	金科股份	1,342,986.00	2.63
27	002128	露天煤业	1,336,332.00	2.62
28	000049	德赛电池	1,316,102.00	2.58
29	300166	东方国信	1,310,130.36	2.57
30	600611	大众交通	1,307,422.00	2.56
31	603198	迎驾贡酒	1,305,193.00	2.56
32	002345	潮宏基	1,302,994.00	2.55
33	600939	重庆建工	1,295,679.52	2.54
34	000813	德展健康	1,269,810.50	2.49

35	002276	万马股份	1,259,963.00	2.47
36	600869	智慧能源	1,248,087.00	2.45
37	002444	巨星科技	1,245,769.00	2.44
38	603369	今世缘	1,237,172.00	2.43
39	300383	光环新网	1,231,287.00	2.41
40	600779	水井坊	1,220,418.00	2.39
41	600338	西藏珠峰	1,206,207.00	2.37
42	600062	华润双鹤	1,204,252.00	2.36
43	600694	大商股份	1,199,948.00	2.35
44	002359	北讯集团	1,189,258.60	2.33
45	002028	思源电气	1,181,544.00	2.32
46	601005	重庆钢铁	1,175,805.00	2.31
47	002233	塔牌集团	1,150,337.00	2.26
48	601020	华钰矿业	1,149,133.00	2.25
49	600507	方大特钢	1,136,720.00	2.23
50	600184	光电股份	1,135,360.00	2.23
51	601016	节能风电	1,132,362.00	2.22
52	600618	氯碱化工	1,121,616.00	2.20
53	600195	中牧股份	1,121,451.00	2.20
54	600657	信达地产	1,114,954.00	2.19
55	000926	福星股份	1,112,636.00	2.18
56	600760	中航沈飞	1,108,253.00	2.17
57	600216	浙江医药	1,107,147.00	2.17
58	002815	崇达技术	1,097,021.00	2.15
59	601233	桐昆股份	1,084,673.00	2.13
60	600649	城投控股	1,083,320.22	2.12
61	002266	浙富控股	1,048,954.00	2.06
62	002701	奥瑞金	1,025,086.00	2.01

### 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	156,913,987.49
卖出股票收入（成交）总额	167,923,267.69

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	---------

			比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,829,075.00	5.08
	其中：政策性金融债	2,829,075.00	5.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,829,075.00	5.08

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	108603	国开 1804	28,150	2,829,075.00	5.08

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,399.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	56,409.28
5	应收申购款	3,404.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,213.36

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	---------------	----------

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

**7.12.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息（转型后）

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
浙商中证 500 增强 A	326	175,734.56	56,833,130.78	99.20%	456,336.96	0.80%
浙商中证 500 增强 C	1	531.01	0.00	0.00%	531.01	100.00%
合计	327	175,198.77	56,833,130.78	99.20%	456,867.97	0.80%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	浙商中证 500 增强 A	112,891.48	0.1971%
	浙商中证 500 增强 C	531.01	100.0000%
	合计	113,422.49	0.2000%

### 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的情况

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	浙商中证 500 增强 A	0~10
	浙商中证 500 增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	浙商中证 500 增强 A	0~10
	浙商中证 500 增强 C	0
	合计	0~10

## § 8 基金份额持有人信息（转型前）

### 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
302	189,693.55	56,833,130.78	99.21%	454,322.46	0.79%

### 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	90,821.54	0.16%

### 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的情况

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	浙商中证 500 增强 A	浙商中证 500 增强 C
基金合同生效日基金份额总额	57,242,904.27	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	178,280.98	531.01
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	131,717.51	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,289,467.74	531.01

## § 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	200,602,551.05
本报告期期初基金份额总额	68,350,819.36
本报告期期间基金总申购份额	463,489.13
减:本报告期期间基金总赎回份额	11,526,855.25
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	57,287,453.24

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

2019 年 4 月 24 日表决通过《关于浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券		262,693,688.82	77.86%	58,387.17	77.86%	-
长江证券	1	17,831,265.84	22.14%	16,605.58	22.14%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

安信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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) 遵循国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定的要求；
- (2) 维护持有人利益，不利用基金资产进行利益输送，不承诺交易量；
- (3) 以券商服务质量作为席位选择和佣金分配的标准。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 股票投资部、市场销售总部

a、专员与券商联系商讨合作意向，根据公司及基金法律文件中对券商席位的选择标准，并参考中央交易室主管的建议，确定新基金租用或基金新租用席位的所属券商以及（主）席位。

b、报公司分管领导审核通过。

(2) 中央交易室

a、专员将我公司格式版本的《证券交易席位使用协议》发送给券商相关业务联系人。

b、券商对我公司提供的协议有修改意见的，其内容若涉及股票投资部、市场销售总部、基金运营部的，由专员分别将此内容发送给上述部门审议，并由专员将我公司各职能部门反馈的意见与券商进行商议，形成一致意见后完成协议初稿，交我公司监察稽核部审核。

c、对券商和我公司双方同意的协议文本进行签字盖章。我公司盖章程序，由专员填写合同流转单，分别送达股票投资部、市场销售总部、基金运营部、监察稽核部签字，最后盖章。

3、本期内本基金券商交易单元变更情况：

- (1) 退租券商交易单元：方正证券（399310）
- (2) 上表中所列交易单元均与浙商聚盈纯债债券型证券投资基金共用。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
太平洋证券	300,540.00	100.00%	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券	2	261,544,835.82	80.62%	243,579.69	80.62%	-
长江证券	1	36,616,739.94	11.29%	34,100.91	11.29%	-
华创证券	1	26,254,611.00	8.09%	24,451.51	8.09%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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）遵循国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定的要求；
- （2）维护持有人利益，不利用基金资产进行利益输送，不承诺交易量；
- （3）以券商服务质量作为席位选择和佣金分配的标准。

2、券商专用交易单元选择程序：

（1）股票投资部、市场销售总部

a、专员与券商联系商讨合作意向，根据公司及基金法律文件中对券商席位的选择标准，并参考中央交易室主管的建议，确定新基金租用或基金新租用席位的所属券商以及（主）席位。

b、报公司分管领导审核通过。

（2）中央交易室

a、专员将我公司格式版本的《证券交易席位使用协议》发送给券商相关业务联系人。

b、券商对我公司提供的协议有修改意见的，其内容若涉及股票投资部、市场销售总部、基金运营

部的，由专员分别将此内容发送给上述部门审议，并由专员将我公司各职能部门反馈的意见与券商进行商议，形成一致意见后完成协议初稿，交我公司监察稽核部审核。

c、对券商和我公司双方同意的协议文本进行签字盖章。我公司盖章程序，由专员填写合同流转单，分别送达股票投资部、市场销售总部、基金运营部、监察稽核部签字，最后盖章。

3、本期内本基金券商交易单元变更情况：

- (1) 新增券商交易单元：太平洋证券（43230）、太平洋证券（007537）；
- (2) 上表中所列交易单元均与浙商聚盈纯债债券型证券投资基金共用。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
太平洋证券	2,628,362.65	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

### 10.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书	《证券时报》	2019 年 4 月 24 日
2	浙商中证 501 指数增强型证券投资基金托管协议	《证券时报》	2019 年 4 月 24 日
3	浙商中证 502 指数增强型证券投资基金基金合同	《证券时报》	2019 年 4 月 24 日
4	浙商基金管理有限公司增加部分基金代销机构并参加费率优惠及开通定投转换功能的公告	《证券时报》	2019 年 4 月 25 日

5	浙商基金管理有限公司基金销售网点及销售人员资格信息的公告	《证券时报》	2019 年 5 月 9 日
6	关于浙商基金管理有限公司基金销售网点及销售人员资格信息的公告	《证券时报》	2019 年 5 月 9 日
7	浙商基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠及开通转换功能的公告	《证券时报》	2019 年 5 月 15 日
8	浙商基金网上交易升级暂停服务的公告	《证券时报》	2019 年 5 月 17 日
9	浙商基金管理有限公司关于新增北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠及开通定投转换功能的公告	《证券时报》	2019 年 5 月 27 日
10	浙商基金管理有限公司关于旗下基金持有的 ST 信威估值调整的公告	《证券时报》	2019 年 5 月 30 日
11	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 6 月 3 日
12	浙商基金管理有限公司关于新增旗下部分基金在上海利得基金销售有限公司开通定投、转换业务并参加费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 6 月 3 日

13	浙商基金管理有限公司关于浙商中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理变更的公告	《证券时报》	2019 年 6 月 4 日
14	浙商基金旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《证券时报》	2019 年 6 月 21 日
15	浙商基金管理有限公司关于新增南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠及开通定投转换功能的公告	《证券时报》	2019 年 6 月 26 日
16	浙商基金 2019 年半年度最后一个交易日基金资产净值等公告	《证券时报》	2019 年 6 月 30 日

### 10.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浙商基金 2018 年年度最后一个交易日基金资产净值等公告	《证券时报》	2019 年 1 月 2 日
2	浙商基金关于升级网上交易暂停服务的公告	《证券时报》	2019 年 1 月 11 日
3	浙商基金管理有限公司关于新增西藏东方财富证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通转换业务及参加费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 1 月 18 日
4	浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《证券时报》	2019 年 1 月 22 日
5	浙商基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换及定期定额投资数量限制的公告	《证券时报》	2019 年 3 月 15 日
6	浙商基金管理有限公司关于以通讯方式召开浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《证券时报》	2019 年 3 月 18 日
7	浙商基金管理有限公司关于以通讯方式召开浙商聚潮灵活配	《证券时报》	2019 年 3 月 19 日

	置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告		
8	浙商基金管理有限公司关于以通讯方式召开浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第 er 次提示性公告	《证券时报》	2019 年 3 月 20 日
9	浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告	《证券时报》	2019 年 3 月 28 日
10	浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告摘要	《证券时报》	2019 年 3 月 28 日
11	浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	《证券时报》	2019 年 4 月 18 日
12	灵活配置持有人大会公证书	《证券时报》	2019 年 4 月 24 日
13	浙商基金管理有限公司关于浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《证券时报》	2019 年 4 月 24 日

## § 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
机构	1	2019-1-1 至 2019-6-30	49,999,000.00	0.00	0.00	49,999,000.00	87.27%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>(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。</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

-
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浙商中证 500 指数增强型证券投资基金设立的相关文件；
- 2、《浙商中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《浙商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《浙商中证 500 指数增强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。

### 12.2 存放地点

杭州市西湖区教工路 18 号世贸丽晶城欧美中心 B 座 507 室

### 12.3 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](http://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

2019 年 8 月 26 日