浙商中证500指数增强型证券投资基金
2025年中期报告

2025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：2025年8月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 48

7.1 期末基金资产组合情况 48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 48
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 50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59
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 59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 60
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 60

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 60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 60
7.12 本报告期投资基金情况 60
7.13 投资组合报告附注 60

§8 基金份额持有人信息 61

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 62

§9 开放式基金份额变动 62

§10 重大事件揭示 62

10.1 基金份额持有人大会决议 62
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 62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 63
10.4 基金投资策略的改变 63
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 63
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 63
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 63
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 63
10.9 其他重大事件 65

§11 影响投资者决策的其他重要信息 66

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 66

§12 备查文件目录 66

12.1 备查文件目录 66
12.2 存放地点 66
12.3 查阅方式 66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	197,167,022.26 份	
基金合同存续期	不定期	
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	170,491,745.40 份	26,675,276.86 份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 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	楼羿南	方圆
	联系电话	021-60350831	95559
	电子邮箱	louyinan@zsfund.com	fangy_20@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	上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 11 楼及 12 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	310012	200336
法定代表人	肖风	任德奇

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.zsfund.com
基金中期报告备置地点	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	上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 11 楼及 12 楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 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	8,127,442.68	1,153,340.43
本期利润	10,942,294.54	2,435,298.44
加权平均基金份额本期利润	0.0633	0.0768
本期加权平均净值利润率	4.20%	5.20%
本期基金份额净值增长率	4.35%	4.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	74,693,712.70	10,882,770.42
期末可供分配基金份额利润	0.4381	0.4080
期末基金资产净值	266,065,608.78	40,787,860.27

期末基金份额净值	1.5606	1.5291
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	60.67%	57.43%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浙商中证 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	4.45%	0.68%	4.09%	0.75%	0.36%	-0.07%
过去三个月	1.48%	1.41%	0.97%	1.43%	0.51%	-0.02%
过去六个月	4.35%	1.22%	3.21%	1.29%	1.14%	-0.07%
过去一年	18.75%	1.54%	18.83%	1.64%	-0.08%	-0.10%
过去三年	-5.52%	1.22%	-7.61%	1.29%	2.09%	-0.07%
自基金合同生效起至今	60.67%	1.27%	5.67%	1.30%	55.00%	-0.03%

浙商中证 500 增强 C

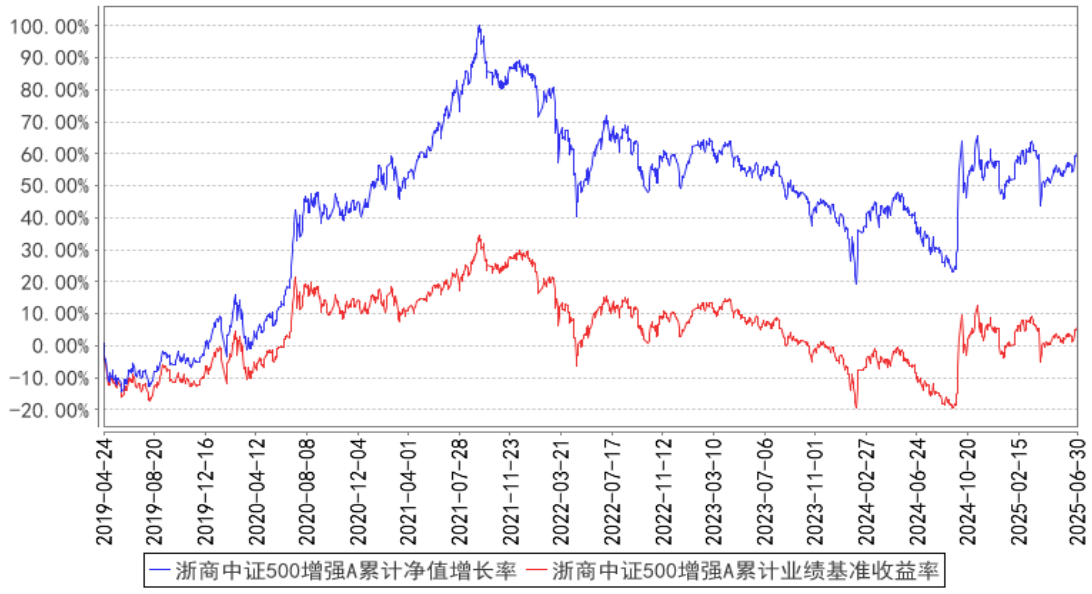
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.43%	0.68%	4.09%	0.75%	0.34%	-0.07%
过去三个月	1.39%	1.41%	0.97%	1.43%	0.42%	-0.02%
过去六个月	4.18%	1.22%	3.21%	1.29%	0.97%	-0.07%
过去一年	18.34%	1.54%	18.83%	1.64%	-0.49%	-0.10%

过去三年	-6.51%	1.22%	-7.61%	1.29%	1.10%	-0.07%
自基金合同生效起至今	57.43%	1.27%	5.67%	1.30%	51.76%	-0.03%

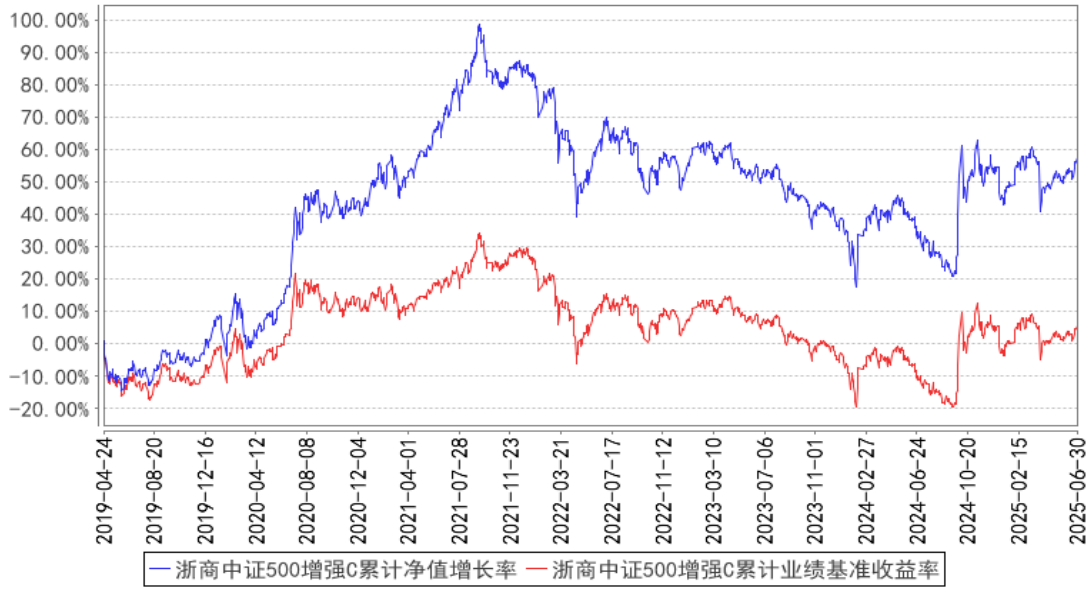
注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

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

浙商中证500增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浙商中证500增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：

1、本基金基金合同生效日为 2019 年 4 月 24 日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金生效时间已满一年。

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2025 年 6 月 30 日，浙商基金共管理三十八只开放式基金——浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、浙商聚盈纯债债券型证券投资基金、浙商日添利货币市场基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、浙商中证 500 指数增强型证券投资基金、浙商惠利纯债债券型证券投资基金、浙商惠裕纯债债券型证券投资基金、浙商惠南纯债债券型证券投资基金、浙商日添金货币市场基金、浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金、浙商全景消费混合型证券投资基金、浙商丰利增强债券型证券投资基金、浙商兴永纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商沪港深精选混合型证券投资基金、浙商智能行业优选混合型发起式证券投资基金、浙商港股通中华交易服务预期高股息指数增强型证券投资基金、浙商惠泉 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浙商丰顺纯债债券型证券投资基金、浙商惠睿纯债债券型证券投资基金、浙商丰裕纯债债券型证券投资基金、浙商中短债债券型证券投资基金、浙商智多兴稳健回报一年持有期混合型证券投资基金、浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金、浙商智多宝稳健一年持有期混合型证券投资基金、浙商惠隆 39 个月定期开放债券型证券投资基金、浙商智选经济动能混合型证券投资基金、浙商智选价值混合型证券投资基金、浙商智多金稳健一年持有期混合型证券投资基金、浙商智选领航三年持有期混合型证券投资基金、浙商智选先锋一年持有期混合型证券投资基金、浙商智多享稳健混合型发起式证券投资基金、浙商智多盈债券型证券投资基金、浙商兴盈 6 个月定期开放债券型证券投资基金、浙商智配瑞享一年持有期债券型基金中基金（FOF）、浙商智选新兴产业混合型证券投资基金、浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

胡羿	本基金的基金经理，公司智能权益投资部副总经理（主持工作）	2021 年 8 月 3 日	-	10 年	胡羿先生，复旦大学金融学硕士，历任雪松控股集团上海资产管理有限公司量化投资经理、五牛股权投资基金管理有限公司量化研究员、东海证券股份有限公司量化研究员。

注：（1）此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，本公司监察风控部将每日审查当天的投资交易，对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

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。本基金按照基金合同的要求，使用数量化的方式运用公司基本面、技术面、产业景气度等数据，构建增强策略，力争达到产生相对基准超额收益的投资目的。同时，通过风险模型实现对各类风险暴露的数量化精细控制，通过持续优化模型来适应市场的持续变化，努力将基金的跟踪误差控制在较低水平下。同时，持续完善 AI 技术在产品管理中的应用，挖掘非标数据中的非线性信息，为产品寻求更多的超额收益来源。报告期内基金完成了控制跟踪目标的既定目标，各类模型平稳运行，相对于基准取得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浙商中证 500 增强 A 的基金份额净值为 1.5606 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.35%；截至本报告期末浙商中证 500 增强 C 的基金份额净值为 1.5291 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.18%；同期业绩比较基准收益率为 3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度 A 股市场波动较大，4 月初受到关税事件影响快速下跌，之后随着市场情绪改善大盘逐步高走，整体区间震荡，以结构性行情为主，新消费、军工、金融表现较好。风格看，成长、小市值风格表现较好。

以 A 股核心指数成分股作为统计样本。目前上市公司净利润增速仍处于 0 附近，ROE 均处于历史较低区间。中长期视角来看，A 股潜在修复空间显著，当前是长期配置高性价比区间。预期全年 A 股市场在无强力政策刺激下，总体较为平稳，以结构性机会为主。密切关注国内经济及上市公司经营质量的修复状态。如果短期出现估值端的回调，我们觉得会是权益市场较好的参与机会。

从去年四季度和今年一季度，市场风格的剧烈变化，量化模型的短期表现出现一定扰动，二季度因子表现总体改善印证了量化投资体系的长期有效性。我们会继续沿着基本面逻辑构建精细化的投资模型，同时利用 AI 捕捉短期交易机会，努力为投资者创造可解释的、可回溯的超额收益。

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，并保持估值政策和程序的一贯性。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作的估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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

本报告期内，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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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中期报告中财务指标、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）

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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	13,281,074.46	16,707,076.25
结算备付金		3,800,584.18	3,349,826.15
存出保证金		336,801.50	1,128,112.95

交易性金融资产	6.4.7.2	291,126,633.22	271,641,381.02
其中：股票投资		277,808,187.63	261,450,268.69
基金投资		-	-
债券投资		13,318,445.59	10,191,112.33
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		14,323.21	-
应收股利		-	-
应收申购款		23,538.39	148,328.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		308,582,954.96	292,974,724.61
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5.22	0.10
应付赎回款		1,287,635.05	474,663.40
应付管理人报酬		124,372.58	126,646.80
应付托管费		24,874.53	25,329.38
应付销售服务费		11,660.03	15,311.73
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	533.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	280,938.50	428,546.44
负债合计		1,729,485.91	1,071,031.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	197,167,022.26	195,843,985.65
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	109,686,446.79	96,059,707.17
净资产合计		306,853,469.05	291,903,692.82

负债和净资产总计		308,582,954.96	292,974,724.61

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日,基金份额总额 197,167,022.26 份，其中浙商中证 500 增强 A 基金份额净值 1.5606 元，份额总额 170,491,745.40 份；浙商中证 500 增强 C 基金份额净值 1.5291 元，份额总额 26,675,276.86 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,520,739.14	-12,527,813.70
1.利息收入		43,728.59	81,893.52
其中：存款利息收入	6.4.7.13	43,728.59	81,893.52
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,294,212.92	-9,993,265.33
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,190,859.10	-13,137,779.42
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	54,995.60	152,620.76
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	147,875.03	-427,313.13
股利收益	6.4.7.20	2,900,483.19	3,419,206.46
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	4,096,809.87	-2,637,366.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	85,987.76	20,924.58

减：二、营业总支出		1,143,146.16	1,232,602.92
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	759,860.56	784,002.46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	151,972.10	156,800.54
3．销售服务费	6.4.10.2.3	81,663.65	86,060.05
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		2,335.84	100.82
其中：卖出回购金融资产支出		2,335.84	100.82
6．信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7．税金及附加		881.66	-
8．其他费用	6.4.7.25	146,432.35	205,639.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,377,592.98	-13,760,416.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,377,592.98	-13,760,416.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,377,592.98	-13,760,416.62

6.3 净资产变动表

会计主体：浙商中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	195,843,985.65	-	96,059,707.17	291,903,692.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	195,843,985.65	-	96,059,707.17	291,903,692.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,323,036.61	-	13,626,739.62	14,949,776.23
（一）、综合收益总额	-	-	13,377,592.98	13,377,592.98
（二）、本期基金	1,323,036.61	-	249,146.64	1,572,183.25

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	58,623,384.84	-	28,665,166.50	87,288,551.34
2.基金赎回款	-57,300,348.23	-	-28,416,019.86	-85,716,368.09
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	197,167,022.26	-	109,686,446.79	306,853,469.05
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	256,149,575.87	-	93,707,934.66	349,857,510.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	256,149,575.87	-	93,707,934.66	349,857,510.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-39,664,361.18	-	-26,472,832.88	-66,137,194.06
（一）、综合收益总额	-	-	-13,760,416.62	-13,760,416.62
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-39,664,361.18	-	-12,712,416.26	-52,376,777.44
其中：1.基金申购款	16,338,462.83	-	5,579,548.98	21,918,011.81

2.基金赎回款	-56,002,824.01	-	-18,291,965.24	-74,294,789.25
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	216,485,214.69	-	67,235,101.78	283,720,316.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘岩	鞠海洋	周志
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

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 号文）批准，由浙商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《浙商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基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 200,602,551.05 份基金份额。

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议生效的公告》，自持有人大会表决结果公告之日（2019 年 4 月 24 日）起，浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金的基金类别将由混合型基金转型为股票型基金，并更名为浙商中证 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 57,287,453.24 份基金份额。本基金的基金管理人为浙商基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《浙商中证 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（含存托凭证）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它股票（非标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证））、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、短期融资券、超短期融资券、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相关规定）。本基金可参与转融通证券出借交易业务。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 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、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%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。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日期间经营的成果和净资产变动情况。

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、衍生工具等。

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

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

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

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

基础的利息的支付。

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

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

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

(b) 金融负债的分类

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

量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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

(a) 金融工具的初始确认

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

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

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

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

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

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

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

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净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

投资收益

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初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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

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

公允价值变动收益

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

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。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

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

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

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

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金在报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	13,281,074.46
等于：本金	13,279,689.41
加：应计利息	1,385.05
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	13,281,074.46

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		273,478,764.69	-	277,808,187.63	4,329,422.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,197,515.00	119,765.59	13,318,445.59	1,165.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,197,515.00	119,765.59	13,318,445.59	1,165.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		286,676,279.69	119,765.59	291,126,633.22	4,330,587.94

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,254,880.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,254,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,254,880.00	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2509	中证 500 股指期货 2509	1.00	1,155,160.00	25,160.00
IC2512	中证 500 股指期货 2512	1.00	1,131,120.00	6,240.00
合计				31,400.00
减:可抵销期货暂收款				31,400.00
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金于本报告期末未持有任何黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金于本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金于本报告期未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	195.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	196,440.82
其中：交易所市场	196,440.82
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	280,938.50

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

浙商中证 500 增强 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	160,613,570.73	160,613,570.73
本期申购	38,805,899.26	38,805,899.26
本期赎回（以“-”号填列）	-28,927,724.59	-28,927,724.59
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	170,491,745.40	170,491,745.40

浙商中证 500 增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,230,414.92	35,230,414.92
本期申购	19,817,485.58	19,817,485.58
本期赎回（以“-”号填列）	-28,372,623.64	-28,372,623.64
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	26,675,276.86	26,675,276.86

注：此处申购含红利再投资、转换入份额、赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期内无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

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
上年度末	62,971,954.30	16,606,606.26	79,578,560.56
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	62,971,954.30	16,606,606.26	79,578,560.56
本期利润	8,127,442.68	2,814,851.86	10,942,294.54
本期基金份额交易产生的变动数	3,594,315.72	1,458,692.56	5,053,008.28
其中：基金申购款	15,630,419.98	4,468,926.01	20,099,345.99
基金赎回款	-12,036,104.26	-3,010,233.45	-15,046,337.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,693,712.70	20,880,150.68	95,573,863.38

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
上年度末	12,873,360.71	3,607,785.90	16,481,146.61
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,873,360.71	3,607,785.90	16,481,146.61
本期利润	1,153,340.43	1,281,958.01	2,435,298.44
本期基金份额交易产生的变动数	-3,143,930.72	-1,659,930.92	-4,803,861.64
其中：基金申购款	7,941,572.67	624,247.84	8,565,820.51
基金赎回款	-11,085,503.39	-2,284,178.76	-13,369,682.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,882,770.42	3,229,812.99	14,112,583.41

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	30,630.76

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	13,001.16
其他	96.67
合计	43,728.59

注：其他列示的是结算保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,190,859.10
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	7,190,859.10

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,011,727,841.25
减：卖出股票成本总额	1,003,504,073.68
减：交易费用	1,032,908.47
买卖股票差价收入	7,190,859.10

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 基金投资收益

本基金在本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	76,526.80
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券	-21,531.20

到期兑付）差价收入	
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	54,995.60

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,236,673.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,062,200.00
减：应计利息总额	196,003.18
减：交易费用	1.62
买卖债券差价收入	-21,531.20

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	147,875.03

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,900,483.19
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,900,483.19

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	3,898,449.87
股票投资	3,873,284.87
债券投资	25,165.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	198,360.00
权证投资	-
期货投资	198,360.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,096,809.87

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	85,746.32
基金转换费收入	241.44
合计	85,987.76

6.4.7.23 持有基金产生的费用

本基金在本报告期内无持有基金产生的费用。

6.4.7.24 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	43,450.00
上清所查询服务费	600.00
债券账户维护费	18,000.00
CDR 存托服务费	79.79
合计	146,432.35

6.4.7.26 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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

4

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

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
浙商证券	-	-	515,397,688.87	33.34

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
浙商证券	-	-	2,055.00	0.02

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）

浙商证券	-	-	2,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 基金交易

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

6.4.10.1.5 权证交易

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

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
浙商证券	487,508.70	34.91	335,942.16	36.75

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

2、根据证券交易单元租用协议，本基金管理人在租用浙商证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从浙商证券获得证券研究综合服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	759,860.56	784,002.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	318,699.65	361,334.24
应支付基金管理人的净管理费	441,160.91	422,668.22

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 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	151,972.10	156,800.54

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 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	4,943.75	4,943.75
合计	-	4,943.75	4,943.75

注：本基金 A 类不收取基金销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.35%/ 当年天数

本基金本报告期未产生关联方销售服务费。

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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未持有过本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	13,281,074.46	30,630.76	10,712,376.70	35,296.04

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2025年6月30日的相关余额为人民币1,469,653.35元。（2024年6月30日：人民币1,388,657.42元）

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

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。

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2025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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股锁定	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市且锁定	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股锁定	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定	27.50	56.19	282	7,755.00	15,845.58	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.52	45.22	264	7,265.44	11,938.08	-
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股锁定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	66	5,913.60	9,205.68	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科	2025 年	6 个月	新股锁	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-

	技	1 月 8 日		定						
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁定	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	26.50	32.68	147	3,895.50	4,803.96	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股锁定	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股锁定	24.18	33.32	98	2,369.64	3,265.36	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定	11.68	26.95	816	9,530.88	21,991.20	-

688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股锁定	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定	47.27	124.16	238	11,250.26	29,550.08	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	13,318,445.59	10,191,112.33
合计	13,318,445.59	10,191,112.33

注：上述表格列示的未评级债券为国债。

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

本基金于本期末及上年度末均未持有长期债券投资。

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金 7 日可变现资产始终保持较高水平，基金资产整体具备良好流动性。

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

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

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

单位：人民币元

本期末 2025 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							
货币资金	13,281,074.46	-	-	-	-	-	13,281,074.46
结算备付金	3,800,584.18	-	-	-	-	-	3,800,584.18
存出保证金	336,801.50	-	-	-	-	-	336,801.50
交易性金融资产	-	-	13,318,445.59	-	-	277,808,187.63	291,126,633.22
应收申购款	-	-	-	-	-	23,538.39	23,538.39
应收清算款	-	-	-	-	-	14,323.21	14,323.21
资产总计	17,418,460.14	-	13,318,445.59	-	-	277,846,049.23	308,582,954.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,287,635.05	1,287,635.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	124,372.58	124,372.58
应付托管费	-	-	-	-	-	24,874.53	24,874.53
应付清算款	-	-	-	-	-	5.22	5.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,660.03	11,660.03
其他负债	-	-	-	-	-	280,938.50	280,938.50
负债总计	-	-	-	-	-	1,729,485.91	1,729,485.91
利率敏感度缺口	17,418,460.14	-	13,318,445.59	-	-	276,116,563.32	306,853,469.05
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	16,707,076.25	-	-	-	-	-	16,707,076.25
结算备付金	3,349,826.15	-	-	-	-	-	3,349,826.15
存出保证金	1,128,112.95	-	-	-	-	-	1,128,112.95
交易性金融资产	10,191,112.33	-	-	-	-	261,450,268.69	271,641,381.02
应收申购款	-	-	-	-	-	148,328.24	148,328.24

资产总计	31,376,127.68	-	-	-	-	261,598,596.93	292,974,724.61
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	474,663.40	474,663.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	126,646.80	126,646.80
应付托管费	-	-	-	-	-	25,329.38	25,329.38
应付清算款	-	-	-	-	-	0.10	0.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,311.73	15,311.73
应交税费	-	-	-	-	-	533.94	533.94
其他负债	-	-	-	-	-	428,546.44	428,546.44
负债总计	-	-	-	-	-	1,071,031.79	1,071,031.79
利率敏感度缺口	31,376,127.68	-	-	-	-	260,527,565.14	291,903,692.82

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	市场利率上升 25 个基点	-10,436.86	-1,701.36
	市场利率下降 25 个基点	10,436.86	1,701.36

注：银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下与自下而上相结合的投

资策略，在科学分析与有效管理信用风险的基础上，实现风险与收益的最佳匹配。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	277,808,187.63	90.53	261,450,268.69	89.57
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	13,318,445.59	4.34	10,191,112.33	3.49
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	291,126,633.22	94.87	271,641,381.02	93.06

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除敏感性分析基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	沪深 300 指数上升 5%	17,180,783.42	15,885,530.34
	沪深 300 指数下降	-17,180,783.42	-15,885,530.34

	5%		

注：本基金以沪深 300 指数作为敏感性分析的基准。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	277,512,339.37	260,968,690.15
第二层次	13,333,831.13	10,218,848.83
第三层次	280,462.72	453,842.04
合计	291,126,633.22	271,641,381.02

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2024 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	277,808,187.63	90.03
	其中：股票	277,808,187.63	90.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,318,445.59	4.32
	其中：债券	13,318,445.59	4.32
	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	17,081,658.64	5.54
8	其他各项资产	374,663.10	0.12
9	合计	308,582,954.96	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	401,744.00	0.13
B	采矿业	9,242,400.11	3.01
C	制造业	172,374,081.29	56.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,965,204.00	2.60
E	建筑业	1,619,848.00	0.53
F	批发和零售业	4,834,665.28	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	4,304,057.04	1.40
H	住宿和餐饮业	452,982.00	0.15

I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,779,189.09	7.10
J	金融业	26,976,804.98	8.79
K	房地产业	3,456,528.00	1.13
L	租赁和商务服务业	2,344,413.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	1,474,149.58	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	1,590,478.00	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	775,608.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	3,939,883.61	1.28
S	综合	-	-
	合计	263,532,035.98	85.88

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	581,116.00	0.19
C	制造业	7,364,246.32	2.40
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	253,469.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,562,507.08	1.16
J	金融业	1,282,055.49	0.42
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	52,398.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,180,359.76	0.38
N	水利、环境和公	-	-

	共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,276,151.65	4.65

7.2.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002138	顺络电子	128,700	3,619,044.00	1.18
2	688249	晶合集成	165,706	3,358,860.62	1.09
3	000893	亚钾国际	110,000	3,315,400.00	1.08
4	000021	深科技	169,800	3,182,052.00	1.04
5	000027	深圳能源	478,700	3,054,106.00	1.00
6	688425	铁建重工	730,741	2,981,423.28	0.97
7	601568	北元集团	715,840	2,970,736.00	0.97
8	600299	安迪苏	299,400	2,889,210.00	0.94
9	688563	航材股份	45,604	2,582,554.52	0.84
10	000959	首钢股份	705,400	2,398,360.00	0.78
11	002340	格林美	367,300	2,332,355.00	0.76
12	601966	玲珑轮胎	157,500	2,310,525.00	0.75
13	688072	拓荆科技	15,000	2,305,650.00	0.75
14	002353	杰瑞股份	63,500	2,222,500.00	0.72
15	000528	柳　　工	228,100	2,192,041.00	0.71
16	300017	网宿科技	196,600	2,107,552.00	0.69
17	002472	双环传动	62,500	2,093,125.00	0.68
18	600707	彩虹股份	321,300	2,075,598.00	0.68
19	600928	西安银行	527,300	2,067,016.00	0.67
20	688100	威胜信息	54,800	2,030,340.00	0.66
21	300002	神州泰岳	171,400	2,022,520.00	0.66
22	002738	中矿资源	62,600	2,013,216.00	0.66
23	300454	深信服	21,200	1,996,616.00	0.65
24	000423	东阿阿胶	37,840	1,979,032.00	0.64
25	603816	顾家家居	77,419	1,975,732.88	0.64

26	000783	长江证券	283,800	1,966,734.00	0.64
27	002065	东华软件	203,379	1,952,438.40	0.64
28	300496	中科创达	33,300	1,905,426.00	0.62
29	300803	指南针	23,460	1,892,283.60	0.62
30	603596	伯特利	35,400	1,865,226.00	0.61
31	603087	甘李药业	33,600	1,840,608.00	0.60
32	600177	雅戈尔	247,115	1,803,939.50	0.59
33	600392	盛和资源	135,600	1,785,852.00	0.58
34	000733	振华科技	35,100	1,756,755.00	0.57
35	000750	国海证券	425,200	1,751,824.00	0.57
36	000009	中国宝安	197,224	1,751,349.12	0.57
37	600369	西南证券	401,600	1,746,960.00	0.57
38	000960	锡业股份	112,700	1,724,310.00	0.56
39	600497	驰宏锌锗	325,800	1,723,482.00	0.56
40	600704	物产中大	326,100	1,718,547.00	0.56
41	002223	鱼跃医疗	48,100	1,712,360.00	0.56
42	002273	水晶光电	85,000	1,697,450.00	0.55
43	600909	华安证券	289,900	1,690,117.00	0.55
44	601717	郑煤机	101,400	1,685,268.00	0.55
45	600637	东方明珠	222,900	1,665,063.00	0.54
46	300285	国瓷材料	95,500	1,656,925.00	0.54
47	002966	苏州银行	188,469	1,654,757.82	0.54
48	300763	锦浪科技	28,800	1,652,832.00	0.54
49	000415	渤海租赁	494,100	1,645,353.00	0.54
50	002939	长城证券	192,000	1,608,960.00	0.52
51	600312	平高电气	103,600	1,594,404.00	0.52
52	600988	赤峰黄金	63,800	1,587,344.00	0.52
53	600998	九州通	307,492	1,580,508.88	0.52
54	600925	苏能股份	302,100	1,579,983.00	0.51
55	002025	航天电器	30,700	1,578,287.00	0.51
56	601179	中国西电	255,700	1,569,998.00	0.51
57	002500	山西证券	268,690	1,569,149.60	0.51
58	002432	九安医疗	42,600	1,551,918.00	0.51
59	000988	华工科技	32,900	1,546,629.00	0.50
60	000060	中金岭南	336,750	1,542,315.00	0.50
61	300037	新宙邦	43,700	1,538,240.00	0.50
62	600535	天士力	97,900	1,532,135.00	0.50
63	688099	晶晨股份	21,235	1,507,897.35	0.49
64	601456	国联民生	145,000	1,500,750.00	0.49
65	300677	英科医疗	63,240	1,497,523.20	0.49
66	600131	国网信通	84,600	1,497,420.00	0.49
67	002673	西部证券	188,900	1,488,532.00	0.49
68	600663	陆家嘴	163,300	1,446,838.00	0.47

69	600959	江苏有线	416,700	1,433,448.00	0.47
70	300573	兴齐眼药	27,460	1,422,153.40	0.46
71	002507	涪陵榨菜	109,607	1,401,873.53	0.46
72	600685	中船防务	51,400	1,397,566.00	0.46
73	300144	宋城演艺	160,000	1,368,000.00	0.45
74	603345	安井食品	16,805	1,351,458.10	0.44
75	300223	北京君正	19,500	1,349,400.00	0.44
76	000513	丽珠集团	37,300	1,344,292.00	0.44
77	601233	桐昆股份	126,300	1,338,780.00	0.44
78	688578	艾力斯	14,165	1,317,911.60	0.43
79	689009	九号公司	22,129	1,309,372.93	0.43
80	603707	健友股份	117,300	1,307,895.00	0.43
81	003022	联泓新科	81,790	1,294,735.70	0.42
82	002185	华天科技	126,211	1,274,731.10	0.42
83	600583	海油工程	233,000	1,272,180.00	0.41
84	688582	芯动联科	18,900	1,270,080.00	0.41
85	300604	长川科技	28,000	1,257,480.00	0.41
86	601921	浙版传媒	153,500	1,237,210.00	0.40
87	688122	西部超导	23,680	1,228,518.40	0.40
88	002429	兆驰股份	280,000	1,226,400.00	0.40
89	002007	华兰生物	78,200	1,225,394.00	0.40
90	300679	电连技术	27,000	1,225,260.00	0.40
91	000987	越秀资本	178,200	1,222,452.00	0.40
92	001213	中铁特货	300,900	1,221,654.00	0.40
93	002850	科达利	10,734	1,214,766.78	0.40
94	300070	碧水源	268,500	1,208,250.00	0.39
95	600004	白云机场	131,500	1,196,650.00	0.39
96	600062	华润双鹤	64,100	1,196,106.00	0.39
97	601158	重庆水务	256,000	1,187,840.00	0.39
98	000878	云南铜业	93,300	1,186,776.00	0.39
99	002532	天山铝业	141,700	1,177,527.00	0.38
100	600132	重庆啤酒	20,984	1,156,218.40	0.38
101	601918	新集能源	177,500	1,146,650.00	0.37
102	002409	雅克科技	20,900	1,143,021.00	0.37
103	300888	稳健医疗	27,100	1,113,810.00	0.36
104	688608	恒玄科技	3,200	1,113,536.00	0.36
105	300001	特锐德	46,400	1,112,208.00	0.36
106	688475	萤石网络	35,096	1,106,225.92	0.36
107	002299	圣农发展	77,400	1,106,046.00	0.36
108	002080	中材科技	55,000	1,072,500.00	0.35
109	688213	思特威	10,430	1,066,154.60	0.35
110	000563	陕国投 A	298,600	1,066,002.00	0.35
111	002410	广联达	79,200	1,062,072.00	0.35

112	601019	山东出版	112,063	1,061,236.61	0.35
113	001696	宗申动力	46,300	1,039,435.00	0.34
114	600820	隧道股份	170,000	1,037,000.00	0.34
115	000039	中集集团	131,900	1,036,734.00	0.34
116	002156	通富微电	39,500	1,011,990.00	0.33
117	600487	亨通光电	65,500	1,002,150.00	0.33
118	600435	北方导航	63,200	985,288.00	0.32
119	300054	鼎龙股份	34,200	980,856.00	0.32
120	601001	晋控煤业	80,100	978,822.00	0.32
121	688002	睿创微纳	14,025	977,823.00	0.32
122	300623	捷捷微电	32,800	977,440.00	0.32
123	600764	中国海防	28,400	965,600.00	0.31
124	603565	中谷物流	100,700	961,685.00	0.31
125	601958	金钼股份	87,102	952,895.88	0.31
126	000591	太阳能	214,500	941,655.00	0.31
127	301165	锐捷网络	15,296	940,092.16	0.31
128	003031	中瓷电子	17,600	936,496.00	0.31
129	600295	鄂尔多斯	107,368	935,175.28	0.30
130	600038	中直股份	23,900	927,559.00	0.30
131	600995	南网储能	94,600	925,188.00	0.30
132	002821	凯莱英	10,460	923,095.00	0.30
133	688278	特宝生物	12,430	896,327.30	0.29
134	002508	老板电器	46,898	891,530.98	0.29
135	600380	健康元	80,300	885,709.00	0.29
136	002385	大北农	218,900	884,356.00	0.29
137	600839	四川长虹	87,700	852,444.00	0.28
138	603160	汇顶科技	12,000	852,360.00	0.28
139	600486	扬农化工	14,500	841,000.00	0.27
140	601665	齐鲁银行	132,000	834,240.00	0.27
141	300395	菲利华	16,300	832,930.00	0.27
142	002202	金风科技	80,800	828,200.00	0.27
143	300207	欣旺达	40,700	816,442.00	0.27
144	601615	明阳智能	70,998	815,767.02	0.27
145	688568	中科星图	22,200	799,422.00	0.26
146	603605	珀莱雅	9,348	773,920.92	0.25
147	601991	大唐发电	241,400	765,238.00	0.25
148	603658	安图生物	20,000	750,000.00	0.24
149	688032	禾迈股份	7,454	744,356.44	0.24
150	688065	凯赛生物	15,772	742,861.20	0.24
151	300558	贝达药业	12,600	730,170.00	0.24
152	300699	光威复材	22,989	728,061.63	0.24
153	600348	华阳股份	108,450	722,277.00	0.24
154	000932	华菱钢铁	162,500	715,000.00	0.23

155	600906	财达证券	103,700	707,234.00	0.23
156	603486	科沃斯	12,100	704,583.00	0.23
157	002262	恩华药业	33,900	704,442.00	0.23
158	601997	贵阳银行	112,400	701,376.00	0.23
159	600325	华发股份	143,600	699,332.00	0.23
160	000785	居然智家	229,200	699,060.00	0.23
161	600582	天地科技	111,900	670,281.00	0.22
162	601696	中银证券	62,300	665,987.00	0.22
163	601061	中信金属	83,700	662,067.00	0.22
164	000997	新 大 陆	20,300	657,314.00	0.21
165	002244	滨江集团	66,800	651,300.00	0.21
166	300373	扬杰科技	12,300	638,370.00	0.21
167	688120	华海清科	3,750	632,625.00	0.21
168	603927	中科软	32,400	626,616.00	0.20
169	688248	南网科技	19,623	617,339.58	0.20
170	600720	中交设计	79,000	610,670.00	0.20
171	002444	巨星科技	23,900	609,689.00	0.20
172	601216	君正集团	108,600	599,472.00	0.20
173	301267	华厦眼科	31,200	598,104.00	0.19
174	300073	当升科技	13,600	596,632.00	0.19
175	600563	法拉电子	5,400	589,086.00	0.19
176	300474	景嘉微	8,000	584,000.00	0.19
177	000729	燕京啤酒	44,500	575,385.00	0.19
178	300012	华测检测	49,000	572,810.00	0.19
179	600056	中国医药	54,660	565,184.40	0.18
180	002152	广电运通	41,440	556,953.60	0.18
181	601228	广州港	169,400	547,162.00	0.18
182	601162	天风证券	107,000	527,510.00	0.17
183	603556	海兴电力	20,000	509,400.00	0.17
184	300627	华测导航	14,080	492,800.00	0.16
185	600298	安琪酵母	14,000	492,380.00	0.16
186	601168	西部矿业	28,921	480,956.23	0.16
187	600378	昊华科技	17,400	471,018.00	0.15
188	600879	航天电子	44,600	466,962.00	0.15
189	002984	森麒麟	24,900	466,875.00	0.15
190	603650	彤程新材	14,100	453,315.00	0.15
191	601399	国机重装	149,500	448,500.00	0.15
192	600483	福能股份	46,500	448,260.00	0.15
193	300339	润和软件	8,700	442,221.00	0.14
194	605589	圣泉集团	15,900	441,225.00	0.14
195	688728	格科微	28,600	440,440.00	0.14
196	600498	烽火通信	20,700	435,321.00	0.14
197	688188	柏楚电子	3,289	433,029.74	0.14

198	000537	中绿电	51,500	430,540.00	0.14
199	603899	晨光股份	14,800	429,052.00	0.14
200	000951	中国重汽	22,200	390,276.00	0.13
201	002430	杭氧股份	19,900	386,458.00	0.13
202	002266	浙富控股	124,100	382,228.00	0.12
203	601000	唐山港	92,834	376,906.04	0.12
204	603529	爱玛科技	10,500	361,200.00	0.12
205	002773	康弘药业	12,000	347,640.00	0.11
206	600258	首旅酒店	23,800	336,294.00	0.11
207	000825	太钢不锈	93,400	335,306.00	0.11
208	603225	新凤鸣	31,400	334,410.00	0.11
209	601611	中国核建	35,600	327,164.00	0.11
210	300136	信维通信	14,600	327,040.00	0.11
211	300919	中伟股份	9,700	318,936.00	0.10
212	600859	王府井	22,200	308,358.00	0.10
213	002683	广东宏大	9,000	305,460.00	0.10
214	300383	光环新网	21,000	300,300.00	0.10
215	601965	中国汽研	16,000	284,000.00	0.09
216	300735	光弘科技	11,300	283,630.00	0.09
217	600007	中国国贸	13,600	279,888.00	0.09
218	600801	华新水泥	22,300	264,032.00	0.09
219	002841	视源股份	7,600	262,960.00	0.09
220	600118	中国卫星	9,200	262,844.00	0.09
221	600970	中材国际	29,800	255,684.00	0.08
222	603589	口子窖	6,900	240,120.00	0.08
223	000739	普洛药业	15,500	217,000.00	0.07
224	600968	海油发展	52,900	215,832.00	0.07
225	002926	华西证券	23,900	213,666.00	0.07
226	600598	北大荒	14,800	213,416.00	0.07
227	600578	京能电力	47,300	212,377.00	0.07
228	000887	中鼎股份	12,000	211,080.00	0.07
229	600895	张江高科	8,100	208,170.00	0.07
230	601118	海南橡胶	39,900	188,328.00	0.06
231	300146	汤臣倍健	16,500	185,460.00	0.06
232	600763	通策医疗	4,300	177,504.00	0.06
233	688385	复旦微电	3,600	177,372.00	0.06
234	601155	新城控股	12,500	171,000.00	0.06
235	300595	欧普康视	10,400	158,808.00	0.05
236	603737	三棵树	4,240	156,244.00	0.05
237	603290	斯达半导	1,900	154,413.00	0.05
238	600499	科达制造	15,700	153,860.00	0.05
239	603893	瑞芯微	1,000	151,860.00	0.05
240	603129	春风动力	700	151,550.00	0.05

241	601636	旗滨集团	29,600	148,296.00	0.05
242	603000	人民网	7,200	145,512.00	0.05
243	601099	太平洋	37,000	145,410.00	0.05
244	600580	卧龙电驱	7,320	144,716.40	0.05
245	601098	中南传媒	10,900	143,008.00	0.05
246	600862	中航高科	5,400	140,832.00	0.05
247	002461	珠江啤酒	12,200	137,738.00	0.04
248	600373	中文传媒	12,700	130,429.00	0.04
249	002056	横店东磁	8,700	123,105.00	0.04
250	002831	裕同科技	5,200	121,784.00	0.04
251	601577	长沙银行	12,200	121,268.00	0.04
252	600754	锦江酒店	5,200	116,688.00	0.04
253	300529	健帆生物	5,100	110,007.00	0.04
254	603228	景旺电子	2,100	87,864.00	0.03
255	002130	沃尔核材	3,600	85,752.00	0.03
256	002195	岩山科技	14,900	83,887.00	0.03
257	002318	久立特材	3,500	81,865.00	0.03
258	300601	康泰生物	5,000	75,950.00	0.02
259	002261	拓维信息	2,400	74,280.00	0.02
260	603659	璞泰来	3,900	73,242.00	0.02
261	600171	上海贝岭	2,100	71,925.00	0.02
262	688375	国博电子	1,123	67,391.23	0.02
263	300724	捷佳伟创	1,200	65,160.00	0.02
264	600329	达仁堂	1,800	60,048.00	0.02
265	600390	五矿资本	8,700	50,721.00	0.02
266	600765	中航重机	2,800	47,264.00	0.02
267	002281	光迅科技	900	44,388.00	0.01
268	688617	惠泰医疗	145	43,065.00	0.01
269	301301	川宁生物	2,700	32,508.00	0.01
270	600901	江苏金租	5,364	32,505.84	0.01
271	688017	绿的谐波	83	10,365.87	0.00
272	688295	中复神鹰	68	1,414.40	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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688739	成大生物	42,400	1,119,360.00	0.36
2	300059	东方财富	47,973	1,109,615.49	0.36
3	300666	江丰电子	14,900	1,104,090.00	0.36
4	001301	尚太科技	22,400	1,092,224.00	0.36
5	600633	浙数文化	69,500	961,880.00	0.31
6	688252	天德钰	35,581	867,464.78	0.28
7	300088	长信科技	143,100	852,876.00	0.28

8	688372	伟测科技	10,551	637,280.40	0.21
9	300113	顺网科技	31,900	630,344.00	0.21
10	600338	西藏珠峰	52,400	581,116.00	0.19
11	300408	三环集团	17,200	574,480.00	0.19
12	300236	上海新阳	14,600	566,480.00	0.18
13	002212	天融信	72,300	556,710.00	0.18
14	603259	药明康德	7,600	528,580.00	0.17
15	002947	恒铭达	15,300	507,807.00	0.17
16	603678	火炬电子	11,400	433,542.00	0.14
17	605111	新洁能	13,800	424,212.00	0.14
18	600728	佳都科技	62,300	339,535.00	0.11
19	600058	五矿发展	32,500	251,225.00	0.08
20	601211	国泰海通	9,000	172,440.00	0.06
21	603444	吉比特	394	118,968.30	0.04
22	002180	纳思达	4,800	110,112.00	0.04
23	301590	优优绿能	656	103,493.58	0.03
24	300031	宝通科技	3,500	87,605.00	0.03
25	001382	新亚电缆	3,660	77,163.78	0.03
26	000061	农 产 品	8,200	52,398.00	0.02
27	301207	华兰疫苗	2,800	47,208.00	0.02
28	688605	先锋精科	744	46,611.60	0.02
29	600176	中国巨石	3,400	38,760.00	0.01
30	688775	影石创新	238	29,550.08	0.01
31	688545	兴福电子	816	21,991.20	0.01
32	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
33	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
34	301275	汉朔科技	282	15,845.58	0.01
35	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
36	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
37	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
38	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
39	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
40	301501	恒鑫生活	264	11,938.08	0.00
41	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
42	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
43	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
44	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
45	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
46	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
47	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
48	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
49	603014	威高血净	147	4,803.96	0.00
50	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00

51	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
52	688516	奥特维	100	3,324.00	0.00
53	603409	汇通控股	98	3,265.36	0.00
54	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
55	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
56	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
57	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	002273	水晶光电	7,675,438.17	2.63
2	688122	西部超导	7,218,793.71	2.47
3	600299	安迪苏	6,945,640.00	2.38
4	688425	铁建重工	6,853,807.41	2.35
5	688249	晶合集成	6,825,257.45	2.34
6	000021	深科技	6,375,419.00	2.18
7	601216	君正集团	6,317,237.00	2.16
8	002138	顺络电子	6,255,116.00	2.14
9	688563	航材股份	5,913,209.51	2.03
10	600578	京能电力	5,834,831.00	2.00
11	601568	北元集团	5,728,958.60	1.96
12	603596	伯特利	5,459,857.00	1.87
13	002281	光迅科技	5,415,894.00	1.86
14	600925	苏能股份	5,322,302.00	1.82
15	002429	兆驰股份	5,302,058.00	1.82
16	688065	凯赛生物	5,251,490.22	1.80
17	600295	鄂尔多斯	5,108,870.44	1.75
18	600707	彩虹股份	5,036,110.00	1.73
19	600143	金发科技	5,016,985.00	1.72
20	600528	中铁工业	4,972,573.31	1.70

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002273	水晶光电	8,548,968.00	2.93
2	600578	京能电力	8,071,936.00	2.77
3	601717	郑煤机	6,601,465.00	2.26
4	600528	中铁工业	6,563,388.34	2.25
5	002465	海格通信	6,443,123.00	2.21

6	688122	西部超导	6,335,004.15	2.17
7	002444	巨星科技	6,252,966.00	2.14
8	600060	海信视像	6,101,740.00	2.09
9	601216	君正集团	5,960,982.00	2.04
10	002128	电投能源	5,945,057.00	2.04
11	302132	中航成飞	5,902,585.00	2.02
12	002064	华峰化学	5,825,097.65	2.00
13	002558	巨人网络	5,798,720.00	1.99
14	600316	洪都航空	5,750,242.00	1.97
15	600282	南钢股份	5,466,144.00	1.87
16	600258	首旅酒店	5,464,176.00	1.87
17	603596	伯特利	5,431,558.00	1.86
18	300476	胜宏科技	5,361,367.00	1.84
19	002281	光迅科技	5,233,791.00	1.79
20	600563	法拉电子	5,205,175.00	1.78

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,015,988,707.75
卖出股票收入（成交）总额	1,011,727,841.25

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

7.5 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	13,318,445.59	4.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	13,318,445.59	4.34

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	019758	24 国债 21	132,000	13,318,445.59	4.34

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

当基金仓位较低以及基差负向较大时，买入期货以获取超额收益。

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 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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	336,801.50
2	应收清算款	14,323.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,538.39

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	374,663.10

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占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

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	17,517	9,732.93	32,323,526.31	18.96	138,168,219.09	81.04
浙商中证 500 增强 C	4,283	6,228.18	0.00	0.00	26,675,276.86	100.00
合计	21,800	9,044.36	32,323,526.31	16.39	164,843,495.95	83.61

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

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	205,993.85	0.1208
	浙商中证 500 增强 C	24,956.82	0.0936
	合计	230,950.67	0.1171

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浙商中证 500 增强 A	10~50
	浙商中证 500 增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	浙商中证 500 增强 A	10~50
	浙商中证 500 增强 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

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（2019 年 4 月 24 日）基金份额总额	57,242,904.27	-
本报告期期初基金份额总额	160,613,570.73	35,230,414.92
本报告期基金总申购份额	38,805,899.26	19,817,485.58
减：本报告期基金总赎回份额	28,927,724.59	28,372,623.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	170,491,745.40	26,675,276.86

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

2025 年 3 月 3 日，楼羿南女士担任浙商基金管理有限公司督察长职务；

2025 年 3 月 3 日，纪士鹏先生离任浙商基金管理有限公司督察长职务。

本报告期内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、基金托管业务未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼事项。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理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。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
太平洋证券	2	581,788,322.59	28.71	113,982.20	28.71	-
开源证券	1	566,786,889.92	27.97	111,062.67	27.97	-
甬兴证券	1	566,202,846.89	27.94	110,924.92	27.94	-
华创证券	1	311,798,297.50	15.39	61,083.57	15.38	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

（1）注册资本符合规定；

（2）财务状况良好；

（3）无重大违法违规记录；

（4）符合监管评级的等级标准；

（5）具备规范的公司治理结构及健全的合规、风险管理和内部控制制度；

（6）其他监管规定的相关要求。

2、券商专用交易单元选择程序：

（1）本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用交易席位的证券经营机构；

（2）本基金管理人与选定的证券经营机构签订协议。

3、本基金报告期内券商交易单元变更情况：

（1）新增或退租券商交易单元：新增华安证券（018798）；

（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、浙商丰裕纯债债券型证券投资基金和浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金共用。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	-	-	-	-	-	-
开源证券	13,197,515.00	99.69	20,500,000.00	100.00	-	-
甬兴证券	40,673.60	0.31	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-01-21
2	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-19
3	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-19
4	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-24
5	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-24
6	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-29
7	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2025-04-11
8	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定报刊及网站	2025-04-11
9	浙商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-04-18

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

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§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规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

上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 11 楼及 12 楼

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 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-067-9908/021-60359000 查询相关信息。

浙商基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日