

浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金2019年第二季度报告

2019-06-30
基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2019-07-19

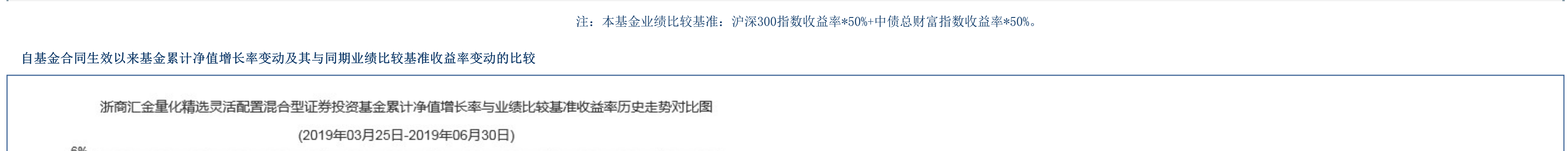
目录全部展开 目录全部收拢
重要提示
基金基本情况
主要财务指标和基金净值表现
管理人报告
公平交易专项说明
投资组合报告

重要提示
浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会及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责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
浙江浙商证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额净值不受波动。
本报告中的财务资料未经审计。
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。
本报告自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况
项目 数值
基金简称 浙商汇金量化精选混合
场内简称 量化精选
基金代码 006149
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2019-03-25
报告期末基金份额总额 116,449,341.98
投资目标 本基金采用数量化方法进行资产配置和个股精选，力争在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略 (一) 资产配置策略 本基金为灵活配置混合型基金，以追求基金资产收益长期增长为目标。在本基金的投资范围内对各类别资产进行灵活的比例配置调整，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。
(二) 股票投资策略 本基金以多因子选股策略为主体，事件驱动策略为补充，精选个股进行组合配置，从而追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。
业绩比较基准 沪深300指数收益率×50%+中债总财富指数收益率×50%
风险收益特征 本基金为混合型基金，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人 浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人 中国农业银行股份有限公司

主要财务指标
单位：人民币元
主要财务指标 报告期（2019-04-01至2019-06-30）
本期已实现收益 510,266.48
本期利润 5,322,508.03
加权平均基金份额本期利润 0.0227
期末基金资产净值 120,796,976.90
期末基金份额净值 1.0373

基金净值表现
本报告期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 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 3.71% 0.76% -0.23% 0.74% 3.97% 0.02%



其他指标
单位：人民币元
其他指标 报告期（2019-04-01至2019-06-30）
报告期末基金份额总额 116,449,341.98

基金经理（或基金经理小组）简介
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明
周琦 总经理助理；本基金基金经理；浙商汇金转型升级混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型基金及浙商汇金中证转债成长指数证券投资基金的基金经理 2019-04-10 - 13年
中国国籍，硕士。曾任国金证券研究所房地产行业分析师、齐鲁证券研究所所长、浙商证券投资部总经理、浙商资本副总经理。2017年加入浙江浙商证券资产管理有限公司，现任总经理助理、浙商汇金转型升级混合型基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型基金、浙商汇金中证转债成长指数基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型基金基金经理。拥有基金从业资格及证券投资基金从业资格。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、其他相关法律法规和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，以谋求基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

公平交易专项说明
公平交易制度的执行情况
本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《浙江浙商证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。
报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内，本基金净值上涨3.74%，跑赢上证综指（-3.62%）和沪深300（-1.21%）等主要市场指数。基金管理人结合国内资本市场波动环境，依托本基金战略资产配置策略以及战术调整策略，进行资产配置与组合管理。在具体个股选择方面，本基金以成熟的四因子选股策略为主体，精选个股进行组合配置。为防范各类个股风险事件，本基金通过风险监控系统及研究员筛选过滤等手段严格约束选股范围。

报告期内基金的业绩表现
截至报告期末浙商汇金量化精选混合基金份额净值为1.0373元。本报告期内，基金份额净值增长率为3.74%，同期业绩比较基准收益率为-0.23%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内，本基金未发生《公开募集证券投资基金运作管理办法》的第四十一条所述情形。

投资组合报告
报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）
1 权益类投资 94,599,673.94 77.25
其中：股票 94,599,673.94 77.25
2 固定收益投资 - -
其中：债券 - -
资产支持证券 - -
3 贵金属投资 - -
4 金融衍生品投资 - -
5 买入返售金融资产 - -
其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -
6 银行存款和结算备付金合计 27,594,300.82 22.53
7 其他资产 282,850.87 0.23
8 合计 122,456,825.63 100.00

报告期末按行业分类的境内股票投资组合
序号 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）
A 农、林、牧、渔业 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 32,216,203.49 28.67
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 8,610,093.00 7.13
G 交通运输、仓储和邮政业 - -
H 住宿和餐饮业 - -
I 信息技术、软件和信息技术服务业 4,686,945.00 3.88
J 金融业 37,793,340.00 31.29
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 11,269,985.85 9.33
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 23,106.60 0.02
S 综合 - -
合计 94,599,673.94 78.31

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）
港股通 - -
注：本报告期末，本基金未持有港股投资股票。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
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 601888 中国国旅 127,129 11,269,985.85 9.33
2 600036 招商银行 287,500 10,344,250 8.56
3 601188 中国平安 599,700 9,738,219 8.06
4 601166 兴业银行 599,700 9,322,413 7.72
5 601933 永辉超市 843,300 8,610,093 7.13
6 600887 伊利股份 255,900 8,549,619 7.08
7 600030 中信证券 291,000 6,928,710 5.74
8 600385 海澜之家 131,400 5,453,100 4.51
9 000333 美的集团 102,300 5,305,278 4.39
10 600271 航天信息 207,600 4,785,180 3.96

报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）
1 国家债券 - -
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 - -
注：本基金本报告期末未持有债券。

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债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量（张） 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）
注：本基金本报告期末未持有债券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。

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。

本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未参与股指期货交易。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未参与国债期货交易。

报告期末本基金投资的国债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） 风险指标说明
公允价值变动总额合计（元） - -
国债期货投资本期收益（元） - -
国债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国债期货。

本期国债期货投资评价

投资组合报告附注
受到调查以及处罚情况
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未收到监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。
申明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
本基金投资的前十名证券中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的证券。

其他资产构成
序号 名称 金额（元） 单位：人民币元
1 存出保证金 35,553.56
2 应收证券清算款 - -
3 应收股利 - -
4 应收利息 2,349.65
5 应收申购款 224,947.66
6 其他应收款 - -
7 待摊费用 - -
8 其他 - -
9 合计 262,850.87

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金期末前十名股票中不存在流通受限情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，投资组合报告中非货币净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

开放式基金份额变动
单位：份
项目 数值
报告期初基金份额总额 284,978,059.83
报告期期间基金总申购份额 2,071,009.52
减：报告期期间基金总赎回份额 170,600,727.77
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） 0
报告期末基金份额总额 116,449,341.98
注：总申购份额含红利再投、转入份额，总赎回份额含赎回费。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况
基金管理人持有本基金份额变动情况
单位：份
项目 基金份额
报告期初和基金管理人持有的基金份额 0
报告期期间买入/申购总份额 0
报告期期间卖出/赎回总份额 0
报告期末基金管理人持有的基金份额 0
报告期末持有的基金份额占基金份额总额的比例（%） -
注：本报告期内基金管理人未持有本基金。

基金管理人固有资金投资本基金交易明细
序号 交易方式 交易日期 交易份额（份） 交易金额（元） 适用费率
合计
注：报告期内基金管理人未发生固有资金申购、赎回本基金的情况。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况
项目 持有份额总数 持有份额占基金总份额比例 发起份额总数 发起份额占基金总份额比例 发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金 -% -%
基金管理人高级管理人员 -% -%
基金基金经理人员 -% -%
基金管理人股东 -% -%
其他 -% -%
合计 -% -%

报告期末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 序号 持有基金份额比例达到或超过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 - - 产品持有风险
个人 - -
注：报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

影响投资者决策的其他重要信息
报告期内未出现其他影响投资者决策的重要信息。

备查文件目录
中国证监会批准设立浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金的文件；
《浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
《浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
报告期内在指定网站上披露的各项公告；
基金管理人业务资格批件、营业执照。
存放地点
杭州市下城区五星路201号浙商证券大厦7楼。
查阅方式
投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：www.stock.com.cn。