

浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2019 年半年度报告摘要

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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文, 投资者欲了解详细内容, 应阅读半年度报告。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	浙商沪深 300 指数增强 (LOF)
场内简称	浙商 300
基金主代码	166802
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2018 年 8 月 20 日
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	168,050,883.05 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为沪深 300 指数增强型基金，在对沪深 300 指数有效跟踪的基础上，通过量化投资方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益和基金资产的长期稳定投资回报。
投资策略	本基金在按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合的基础上，采用量化模型对成份股的权重进行相应调整，力求在控制与业绩比较基准之间偏离度的前提下获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浙商基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	郑鹏
	联系电话	021-60350812	010-85238667
	电子邮箱	guoleqi@zsfund.com	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		4000-679-908/021-60359000	95577
传真		0571-28191919	010-85238680

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网	http://www.zsfund.com
--------------------	---

网址	
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	6,411,169.37
本期利润	18,934,583.19
加权平均基金份额本期利润	0.2953
本期加权平均净值利润率	24.98%
本期基金份额净值增长率	26.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	65,452,701.09
期末可供分配基金份额利润	0.3895
期末基金资产净值	211,452,430.78
期末基金份额净值	1.2583
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	13.26%

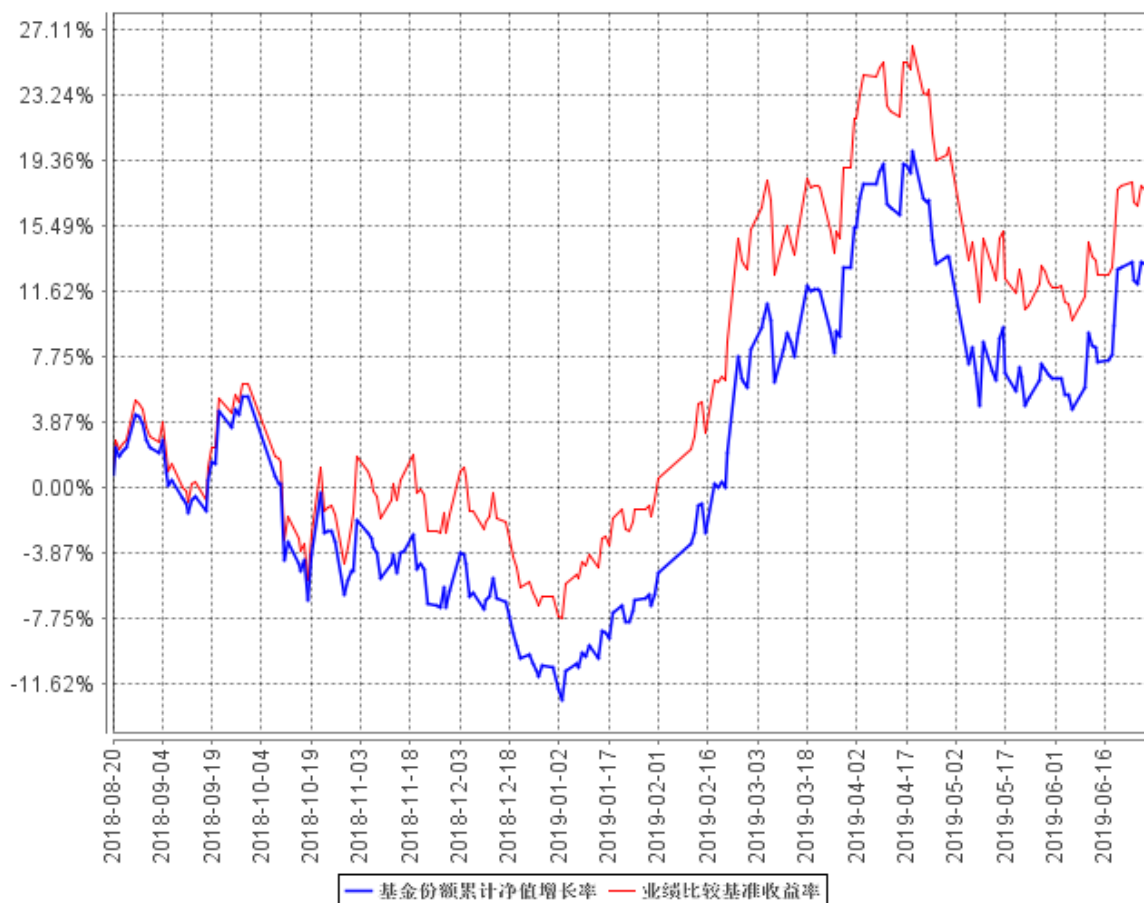
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.36%	1.13%	5.13%	1.08%	1.23%	0.05%
过去三个月	0.18%	1.47%	-1.10%	1.44%	1.28%	0.03%
过去六个月	26.62%	1.46%	25.66%	1.47%	0.96%	-0.01%
自基金合同生效起至今	13.26%	1.44%	17.63%	1.46%	-4.37%	-0.02%

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

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、本基金由浙商沪深 300 指数分级证券投资基金转型而来，本基金基金合同生效日为 2018 年 8 月 20 日，截至本报告期末，本基金转型未满一年。

2、本基金建仓期为 6 个月，从 2018 年 8 月 20 日至 2019 年 2 月 19 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,浙商基金共管理十八只开放式基金——浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金、浙商丰利增强债券型证券投资基金、浙商中证 500 指数增强型证券投资基金、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、浙商聚盈纯债债券型证券投资基金、浙商日添金货币市场基金、浙商日添利货币市场基金、浙商全景消费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。

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		
王剑	本基金的基金经理助理	2018 年 8 月 24 日	-	4	王剑先生,复旦大学物理学博士。曾任东证期货研究员助理。
查晓磊	本基金的基金经理,公司智能投资部总经理	2018 年 8 月 20 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。

注:王剑于 2019 年 8 月 7 日担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,继续按照沪深 300 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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2583 元；本报告期基金份额净值增长率为 26.62%，业绩比较基准收益率为 25.66%。

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占优于债券，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

本报告期内, 本基金托管人在对本基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的有关规定和基金合同、托管协议的约定, 依法安全保管了基金财产, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本托管人认为, 浙商基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上, 不存在损害基金份额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为, 浙商基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: 浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

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	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	3,039,285.98	586,679.95
结算备付金		255,950.23	513,925.34
存出保证金		47,339.84	50,831.49
交易性金融资产	6.4.7.2	208,504,277.70	54,474,810.01
其中: 股票投资		199,412,398.10	51,472,658.41
基金投资		-	-
债券投资		9,091,879.60	3,002,151.60
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	150,196.64	83,953.96
应收股利		-	-
应收申购款		4,418.23	3,113.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		212,001,468.62	55,713,314.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		25.27	25.27
应付赎回款		10,612.31	36,862.44
应付管理人报酬		112,120.89	48,481.03
应付托管费		24,666.60	10,665.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	274,233.21	119,510.26

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	127,379.56	256,950.00
负债合计		549,037.84	472,494.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	145,999,729.69	48,290,258.08
未分配利润	6.4.7.10	65,452,701.09	6,950,561.36
所有者权益合计		211,452,430.78	55,240,819.44
负债和所有者权益总计		212,001,468.62	55,713,314.28

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2583 元，基金份额总额 168,050,883.05 份。

6.2 利润表

会计主体：浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		20,122,239.71	-
1.利息收入		67,738.93	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,543.77	-
债券利息收入		55,195.16	-
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）		7,524,543.02	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,937,271.85	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-13,808.23	-
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	1,601,079.40	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	12,523,413.82	-
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	6,543.94	-

减：二、费用		1,187,656.52	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	373,566.05	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	82,184.58	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	566,366.74	-
5. 利息支出		109.59	-
其中：卖出回购金融资产支出		109.59	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	165,429.56	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,934,583.19	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,934,583.19	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 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）	48,290,258.08	6,950,561.36	55,240,819.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,934,583.19	18,934,583.19
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）	97,709,471.61	39,567,556.54	137,277,028.15
其中：1. 基金申购款	108,354,032.36	43,382,075.54	151,736,107.90
2. 基金赎回款	-10,644,560.75	-3,814,519.00	-14,459,079.75
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）	145,999,729.69	65,452,701.09	211,452,430.78

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 (基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

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：

<u> 聂挺进 </u>	<u> 唐生林 </u>	<u> 唐生林 </u>
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

浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) (原浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 (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”) 《关于核准浙商沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》 (证监许可 [2012] 91 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》等相关法规和《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2012 年 5 月 7 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集规模为 354, 363, 602. 17 份基金份额。

根据《浙商基金管理有限公司关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金转型后基金名称、基金简称及基金类型变更的公告》，原基金的浙商稳健份额、浙商进取份额将于 2018 年 8 月 13 日终止上市，原基金将在基金份额转换基准日（2018 年 8 月 17 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指数分级基金变更为指数增强基金（LOF），基金名称由“浙商沪深 300 指数分级证券投资基金”变更为“浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）”，本基金不再设置基金份额的分级。根据《关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额转换的公告》，在份额转换基准日（2018 年 8 月 17 日）的日终，将原基金的浙商稳健份额、浙商进取份额按照转换当日各自相应的基金份额参考净值转换成本基金的浙商沪深 300 份额的场内份额，将原基金的浙商沪深 300 份额的场内份额变更登记为本基金的场内份额，将原基金的浙商沪深 300 份额的场外份额变更登记为本基金的场外份额。于 2018 年 8 月 20 日，《浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，基金规模为 20,207,939.56 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，基金托管人为华夏银行股份有限公司（以下称“华夏银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》和《浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小版股票、创业板股票以及中国证监会允许基金投资的其他股票）、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、短期融资债券、超短期融资债券、中小企业私募债、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。本基金可参与融资及转融通证券出借交易业务。本基金投资于股票的资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产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，应当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。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×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、自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.5 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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在报告期内未发生过重大会计差错。

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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、基金销售机构
华夏银行股份有限公司	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、基金销售机构
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。

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内没有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

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 6 月 30 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管理费	373,566.05	-
其中：支付销售机构的客户维护费	33,176.18	-

注：支付基金管理人浙商基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.0% 的年费率计提，每日计提，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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.8.2.2 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 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	82,184.58	-

注：支付基金托管人华夏银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，每日计提，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2018 年 8 月 20 日）持有的基金份额	2,927,397.69	-
期初持有的基金份额	2,927,397.69	-
期间申购/买入总份额	0.00	-
期间因拆分变动份额	0.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	-
期末持有的基金份额	2,927,397.69	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.7420%	-

6.4.8.4.2 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未持有本基金。

6.4.8.5 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 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
华夏银行股份有限公司	3,039,285.98	9,804.88	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

本基金通过“华夏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 日的存款余额为人民币 255,950.23 元。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7 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。

6.4.9 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.10.1 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	备注
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	-
300788	中信	2019 年	2019	新股流	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

	出版	6 月 27	年 7 月	通受限						
		日	5 日							

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。

股票 601236（红塔证券）于 2019 年 7 月 5 日上市流通；股票 300788（中信出版）于 2019 年 7 月 5 日上市流通。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	*ST 信	2016 年 12 月 26 日	重大资产重组	5.84	2019 年 7 月 12 日	13.86	4,721	74,640.28	27,570.64	-

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 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。

6.4.10.3.2 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。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	199,412,398.10	94.06
	其中：股票	199,412,398.10	94.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,091,879.60	4.29
	其中：债券	9,091,879.60	4.29
	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	3,295,236.21	1.55
8	其他各项资产	201,954.71	0.10
9	合计	212,001,468.62	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	-	-
B	采矿业	8,326,300.85	3.94
C	制造业	75,967,931.61	35.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,478,032.14	2.59
E	建筑业	6,228,288.00	2.95
F	批发和零售业	4,572,088.56	2.16
G	交通运输、仓储和邮政业	6,243,541.97	2.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,960,366.86	3.76
J	金融业	68,910,276.09	32.59
K	房地产业	9,012,023.72	4.26
L	租赁和商务服务业	2,152,991.36	1.02

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	1,752,902.00	0.83
R	文化、体育和娱乐业	283,446.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	196,888,189.16	93.11

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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	43,836.62	0.02
B	采矿业	80,932.90	0.04
C	制造业	966,628.12	0.46
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	144,109.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.02
J	金融业	1,225,991.94	0.58
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	2,524,208.94	1.19

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	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	191,828	16,997,879.08	8.04
2	000858	五粮液	69,927	8,247,889.65	3.90
3	600519	贵州茅台	8,377	8,242,968.00	3.90
4	600036	招商银行	218,294	7,854,218.12	3.71
5	601166	兴业银行	413,777	7,567,981.33	3.58
6	601328	交通银行	1,227,100	7,509,852.00	3.55
7	000333	美的集团	130,848	6,785,777.28	3.21
8	601668	中国建筑	897,600	5,161,200.00	2.44
9	601006	大秦铁路	480,382	3,886,290.38	1.84
10	600837	海通证券	255,446	3,624,778.74	1.71
11	600031	三一重工	275,600	3,604,848.00	1.70
12	600900	长江电力	197,401	3,533,477.90	1.67
13	000001	平安银行	233,361	3,215,714.58	1.52
14	002475	立讯精密	128,700	3,190,473.00	1.51
15	600028	中国石化	568,499	3,109,689.53	1.47
16	603288	海天味业	29,126	3,058,230.00	1.45
17	000776	广发证券	203,200	2,791,968.00	1.32
18	600999	招商证券	160,200	2,737,818.00	1.29
19	600050	中国联通	385,900	2,377,144.00	1.12
20	600436	片仔癀	19,800	2,280,960.00	1.08
21	600030	中信证券	92,700	2,207,187.00	1.04
22	600585	海螺水泥	52,865	2,193,897.50	1.04
23	600958	东方证券	195,100	2,083,668.00	0.99
24	002142	宁波银行	84,600	2,050,704.00	0.97
25	601899	紫金矿业	539,600	2,034,292.00	0.96
26	002024	苏宁易购	173,200	1,988,336.00	0.94
27	601398	工商银行	324,616	1,911,988.24	0.90
28	000963	华东医药	70,236	1,823,326.56	0.86
29	600570	恒生电子	26,720	1,820,968.00	0.86
30	601818	光大银行	475,900	1,813,179.00	0.86
31	600606	绿地控股	261,200	1,783,996.00	0.84
32	601238	广汽集团	160,900	1,758,637.00	0.83
33	000661	长春高新	5,200	1,757,600.00	0.83

34	300015	爱尔眼科	56,600	1,752,902.00	0.83
35	600383	金地集团	144,800	1,727,464.00	0.82
36	000338	潍柴动力	139,200	1,710,768.00	0.81
37	300059	东方财富	121,241	1,642,815.55	0.78
38	002311	海大集团	51,700	1,597,530.00	0.76
39	000069	华侨城 A	229,730	1,596,623.50	0.76
40	601888	中国国旅	17,300	1,533,645.00	0.73
41	601377	兴业证券	221,700	1,494,258.00	0.71
42	000100	TCL 集团	439,700	1,464,201.00	0.69
43	600271	航天信息	62,400	1,438,320.00	0.68
44	600438	通威股份	99,637	1,400,896.22	0.66
45	002202	金风科技	108,590	1,349,773.70	0.64
46	300122	智飞生物	30,700	1,323,170.00	0.63
47	300003	乐普医疗	56,800	1,307,536.00	0.62
48	002007	华兰生物	42,050	1,282,104.50	0.61
49	601919	中远海控	254,700	1,278,594.00	0.60
50	000783	长江证券	160,500	1,253,505.00	0.59
51	600309	万华化学	29,100	1,245,189.00	0.59
52	002146	荣盛发展	125,188	1,175,515.32	0.56
53	600660	福耀玻璃	50,557	1,149,160.61	0.54
54	601688	华泰证券	50,000	1,116,000.00	0.53
55	600025	华能水电	272,932	1,110,833.24	0.53
56	600177	雅戈尔	173,134	1,099,400.90	0.52
57	300408	三环集团	56,200	1,093,090.00	0.52
58	600170	上海建工	283,800	1,067,088.00	0.50
59	600188	兖州煤业	97,900	1,064,173.00	0.50
60	600362	江西铜业	67,500	1,062,450.00	0.50
61	600919	江苏银行	145,000	1,052,700.00	0.50
62	600276	恒瑞医药	15,800	1,042,800.00	0.49
63	603160	汇顶科技	7,400	1,027,120.00	0.49
64	000898	鞍钢股份	262,600	995,254.00	0.47
65	002624	完美世界	37,900	978,199.00	0.46
66	601088	中国神华	47,234	962,628.92	0.46
67	601808	中海油服	97,500	938,925.00	0.44
68	000166	申万宏源	184,500	924,345.00	0.44
69	002508	老板电器	33,900	920,046.00	0.44
70	600522	中天科技	99,100	908,747.00	0.43
71	600089	特变电工	123,700	896,825.00	0.42
72	600372	中航电子	59,931	889,376.04	0.42

73	002050	三花智控	82,000	865,100.00	0.41
74	000671	阳光城	129,800	841,104.00	0.40
75	600886	国投电力	107,300	833,721.00	0.39
76	600038	中直股份	19,700	808,094.00	0.38
77	002294	信立泰	35,700	798,966.00	0.38
78	002179	中航光电	23,700	793,002.00	0.38
79	000402	金融街	100,500	787,920.00	0.37
80	600704	物产中大	140,300	760,426.00	0.36
81	603156	养元饮品	20,320	753,465.60	0.36
82	600482	中国动力	28,700	677,894.00	0.32
83	300136	信维通信	25,500	623,475.00	0.29
84	002460	赣锋锂业	25,500	597,465.00	0.28
85	002120	韵达股份	19,180	591,127.60	0.28
86	002466	天齐锂业	21,900	553,632.00	0.26
87	601838	成都银行	61,300	541,279.00	0.26
88	300296	利亚德	60,401	472,939.83	0.22
89	300033	同花顺	4,800	472,128.00	0.22
90	000415	渤海租赁	118,633	465,041.36	0.22
91	600398	海澜之家	50,800	460,756.00	0.22
92	002032	苏泊尔	5,848	443,453.84	0.21
93	600019	宝钢股份	64,000	416,000.00	0.20
94	002555	三七互娱	29,197	395,619.35	0.19
95	600760	中航沈飞	13,100	380,293.00	0.18
96	603260	合盛硅业	7,900	371,774.00	0.18
97	000425	徐工机械	81,000	361,260.00	0.17
98	002601	龙蟠佰利	23,800	352,954.00	0.17
99	600233	圆通速递	25,700	316,881.00	0.15
100	600977	中国电影	18,100	283,446.00	0.13
101	601360	三六零	12,792	273,492.96	0.13
102	601212	白银有色	59,000	259,010.00	0.12
103	600339	中油工程	51,300	216,486.00	0.10
104	002925	盈趣科技	5,418	211,356.18	0.10
105	600104	上汽集团	8,217	209,533.50	0.10
106	603833	欧派家居	1,800	193,716.00	0.09
107	600390	五矿资本	17,100	161,253.00	0.08
108	601828	美凯龙	12,700	154,305.00	0.07
109	000408	藏格控股	16,000	132,320.00	0.06
110	002468	申通快递	3,700	92,278.00	0.04
111	601298	青岛港	9,341	78,370.99	0.04

112	000651	格力电器	80	4,400.00	0.00
113	002415	海康威视	52	1,434.16	0.00
114	600583	海油工程	19	106.40	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	占基金资产净值比例 (%)
1	601128	常熟银行	78,600	606,792.00	0.29
2	600909	华安证券	89,500	585,330.00	0.28
3	002085	万丰奥威	63,500	462,280.00	0.22
4	000959	首钢股份	98,700	347,424.00	0.16
5	001965	招商公路	17,300	144,109.00	0.07
6	600968	海油发展	22,798	80,932.90	0.04
7	300782	卓胜微	520	56,638.40	0.03
8	300761	立华股份	818	43,836.62	0.02
9	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
10	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
11	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
12	600485	*ST 信	4,721	27,570.64	0.01
13	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
14	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
15	603863	松炆资源	604	13,940.32	0.01

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	601318	中国平安	11,789,822.83	21.34
2	601328	交通银行	7,950,981.00	14.39
3	601166	兴业银行	7,912,624.12	14.32
4	000858	五粮液	7,793,252.00	14.11
5	600519	贵州茅台	7,676,057.76	13.90
6	000333	美的集团	7,340,081.36	13.29
7	600036	招商银行	6,222,024.00	11.26

8	601668	中国建筑	6,050,499.82	10.95
9	600837	海通证券	4,539,199.64	8.22
10	600900	长江电力	4,086,489.03	7.40
11	603288	海天味业	3,674,557.34	6.65
12	000001	平安银行	3,662,306.25	6.63
13	601818	光大银行	3,488,857.00	6.32
14	600028	中国石化	3,474,911.15	6.29
15	601288	农业银行	3,455,922.00	6.26
16	601006	大秦铁路	3,435,367.00	6.22
17	600031	三一重工	3,135,693.00	5.68
18	600606	绿地控股	3,088,922.46	5.59
19	600050	中国联通	2,720,685.00	4.93
20	600999	招商证券	2,696,476.00	4.88
21	000776	广发证券	2,647,086.00	4.79
22	601398	工商银行	2,507,270.00	4.54
23	002475	立讯精密	2,422,453.00	4.39
24	601238	广汽集团	2,414,055.00	4.37
25	601899	紫金矿业	2,402,576.00	4.35
26	600276	恒瑞医药	2,364,000.00	4.28
27	600030	中信证券	2,312,166.00	4.19
28	002024	苏宁易购	2,207,415.00	4.00
29	600436	片仔癀	2,197,430.00	3.98
30	300059	东方财富	2,049,228.26	3.71
31	600048	保利地产	2,046,339.00	3.70
32	002142	宁波银行	2,028,011.00	3.67
33	000069	华侨城 A	2,020,099.00	3.66
34	600958	东方证券	2,019,593.00	3.66
35	600271	航天信息	1,928,255.00	3.49
36	601377	兴业证券	1,928,203.80	3.49
37	601601	中国太保	1,878,936.00	3.40
38	300003	乐普医疗	1,875,419.00	3.39
39	601211	国泰君安	1,828,456.00	3.31
40	601998	中信银行	1,795,910.00	3.25
41	002311	海大集团	1,794,084.00	3.25
42	000963	华东医药	1,780,921.00	3.22
43	000338	潍柴动力	1,763,745.00	3.19

44	600570	恒生电子	1,745,251.00	3.16
45	600438	通威股份	1,736,247.44	3.14
46	600585	海螺水泥	1,706,261.00	3.09
47	600170	上海建工	1,679,069.00	3.04
48	000100	TCL 集团	1,611,056.00	2.92
49	300015	爱尔眼科	1,605,039.00	2.91
50	000661	长春高新	1,570,012.00	2.84
51	601688	华泰证券	1,434,964.00	2.60
52	600177	雅戈尔	1,397,155.20	2.53
53	600383	金地集团	1,396,813.00	2.53
54	600188	兖州煤业	1,370,301.00	2.48
55	600886	国投电力	1,367,880.00	2.48
56	601788	光大证券	1,335,410.00	2.42
57	002202	金风科技	1,328,736.40	2.41
58	600025	华能水电	1,326,525.60	2.40
59	600690	海尔智家	1,317,252.00	2.38
60	002415	海康威视	1,292,957.00	2.34
61	000651	格力电器	1,273,354.00	2.31
62	601888	中国国旅	1,271,474.00	2.30
63	600089	特变电工	1,267,245.00	2.29
64	601919	中远海控	1,232,536.00	2.23
65	000895	双汇发展	1,222,695.00	2.21
66	601390	中国中铁	1,209,627.00	2.19
67	002007	华兰生物	1,187,570.00	2.15
68	600309	万华化学	1,184,895.00	2.14
69	000671	阳光城	1,175,740.00	2.13
70	600660	福耀玻璃	1,165,117.00	2.11
71	600372	中航电子	1,161,094.40	2.10
72	000783	长江证券	1,158,537.00	2.10
73	300408	三环集团	1,157,976.00	2.10
74	600482	中国动力	1,151,753.00	2.08
75	601186	中国铁建	1,140,008.00	2.06
76	601857	中国石油	1,115,987.00	2.02

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	601288	农业银行	4,917,610.74	8.90
2	000651	格力电器	3,843,713.00	6.96
3	601211	国泰君安	3,156,420.64	5.71
4	601166	兴业银行	2,810,992.00	5.09
5	000858	五粮液	2,657,596.00	4.81
6	600900	长江电力	2,396,566.40	4.34
7	002304	洋河股份	2,292,339.19	4.15
8	601818	光大银行	2,179,054.09	3.94
9	601857	中国石油	2,080,121.00	3.77
10	601601	中国太保	2,024,563.00	3.66
11	600036	招商银行	1,986,776.00	3.60
12	600048	保利地产	1,915,350.00	3.47
13	600016	民生银行	1,833,650.75	3.32
14	601998	中信银行	1,801,193.00	3.26
15	601117	中国化学	1,748,196.00	3.16
16	600660	福耀玻璃	1,690,921.00	3.06
17	300408	三环集团	1,614,037.00	2.92
18	601788	光大证券	1,561,807.00	2.83
19	601229	上海银行	1,556,838.00	2.82
20	600028	中国石化	1,546,389.00	2.80
21	601555	东吴证券	1,539,041.00	2.79
22	600837	海通证券	1,533,384.33	2.78
23	600276	恒瑞医药	1,531,592.00	2.77
24	000333	美的集团	1,516,612.00	2.75
25	601318	中国平安	1,479,970.00	2.68
26	600332	白云山	1,479,704.12	2.68
27	000568	泸州老窖	1,460,989.46	2.64
28	600219	南山铝业	1,444,509.00	2.61
29	600606	绿地控股	1,433,380.00	2.59
30	600050	中国联通	1,432,609.00	2.59
31	002146	荣盛发展	1,373,722.00	2.49
32	601877	正泰电器	1,316,999.00	2.38
33	601186	中国铁建	1,269,751.00	2.30

34	000895	双汇发展	1,231,690.72	2.23
35	600690	海尔智家	1,205,508.00	2.18
36	601390	中国中铁	1,199,356.00	2.17
37	300122	智飞生物	1,143,930.00	2.07
38	000002	万 科 A	1,120,410.00	2.03

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	269,780,488.27
卖出股票收入（成交）总额	140,317,780.42

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	5,407,670.40	2.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,684,209.20	1.74
	其中：政策性金融债	3,684,209.20	1.74
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	9,091,879.60	4.30

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	019611	19 国债 01	54,120	5,407,670.40	2.56
2	108603	国开 1804	36,820	3,684,209.20	1.74

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	47,339.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	150,196.64
5	应收申购款	4,418.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	201,954.71

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

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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.12.6 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

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
1,241	135,415.70	153,558,254.71	91.38%	14,492,628.34	8.62%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金不属于上市基金。

8.3 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	51,640.04	0.0307%

8.4 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

单位：份

基金合同生效日（2018 年 8 月 20 日）基金份额总额	20,207,939.56
本报告期期初基金份额总额	55,583,832.77
本报告期期间基金总申购份额	124,719,417.08
减:本报告期期间基金总赎回份额	12,252,366.80
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	168,050,883.05

§ 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

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

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	
西部证券		1196,165,888.06	47.96%	182,689.65	46.88%	-

招商证券	1	127,078,690.99	31.07%	127,081.70	32.61%	-
上海证券	1	85,810,594.03	20.98%	79,915.68	20.51%	-

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) 投资管理部、市场部

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，其内容若涉及投资管理部、市场部、运营保障部的，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，分别送达投资管理部、市场部、运营保障部、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) 本期内本基金券商交易单元未发生变动。

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
西部证券	272,272.00	2.81%	-	-	-	-
招商证券	3,994,419.00	41.28%	-	-	-	-
上海证券	5,409,264.60	55.90%	-	-	-	-

浙商基金管理有限公司

2019 年 8 月 26 日