
浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会、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。本半年度报告已经过全部董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商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。

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。

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03月25日(基金合同生效日)起至2019年06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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	43
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	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
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.....	49
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	浙商汇金聚鑫定开债
基金主代码	006927
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2019年03月25日
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	509,999,097.23份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，结合国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况，综合分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产中的投资比率，构建和调整债券投资组合。</p> <p>2、债券投资组合策略</p> <p>在债券组合的构建和调整上，本基金综合运用久期配置、期限结构配置、类属资产配置、收益率曲线策略、杠杆放大策略等组合管理手段进行日常管理。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 信用债投资策略</p> <p>信用类债券是本基金重要投资标的，信用风险管理对于提高债券组合收益率至关重要。本基金将根据宏观经济运行状况、行业发展周期、公司业务状况、公司治理结构、财务状况等因素综合评估信用风险，确定信用类债券的信用风险利差，有效管理组合的整</p>

	<p>体信用风险。同时，本基金将运用本基金管理人比较完善的信用债券评级体系，研究和跟踪发行主体所属行业周期、业务状况、公司治理结构、财务状况等因素，综合评估发行主体信用风险，确定信用产品的信用风险利差，有效管理组合的整体信用风险。</p> <p>(2) 可转换债券投资策略</p> <p>基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析，并结合市场环境情况等，本基金在一、二级市场投资可转换债券，以达到在严格控制风险的基础上，实现基金资产稳健增值的目的。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>对于资产支持证券，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整收益高的品种进行投资。本基金将严格控制产支持证券的总体投资规模并进行分散，以降低流动性风险。</p> <p>(二) 开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	浙江浙商证券资产管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌
	联系电话	0571-87901630
	电子邮箱	fangbin@stocke.com.cn
客户服务电话	95345	95527

传真	0571-87902581	0571-88268688
注册地址	杭州市下城区天水巷25号	杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址	杭州市江干区五星路201号浙 商证券大楼7层	杭州市延安路368号
邮政编码	310000	310006
法定代表人	盛建龙	沈仁康

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.stocke.com.cn
基金半年度报告备置地点	杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	浙江浙商证券资产管理有限公司	杭州市江干区五星路201号浙商 证券大楼七楼
会计师事务所	北京兴华会计师事务所(特殊普通 合伙)	北京市西城区裕民路18号北环中 心22层

§ 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03月25日（基金合同生效日）- 2019年 06月30日）
本期已实现收益	4,380,948.02
本期利润	5,074,059.57
加权平均基金份额本期利润	0.0099
本期加权平均净值利润率	0.99%

本期基金份额净值增长率	0.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配利润	1,830,952.53
期末可供分配基金份额利润	0.0036
期末基金资产净值	512,523,161.31
期末基金份额净值	1.0049
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2019年06月30日）
基金份额累计净值增长率	0.99%

- 注：1、本基金合同于2019年3月25日起生效，自合同生效日起至报告期末不足半年。
 2、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
 3、本期已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入（不包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。
 4、期末可供分配利润，为期末资产负债表中分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

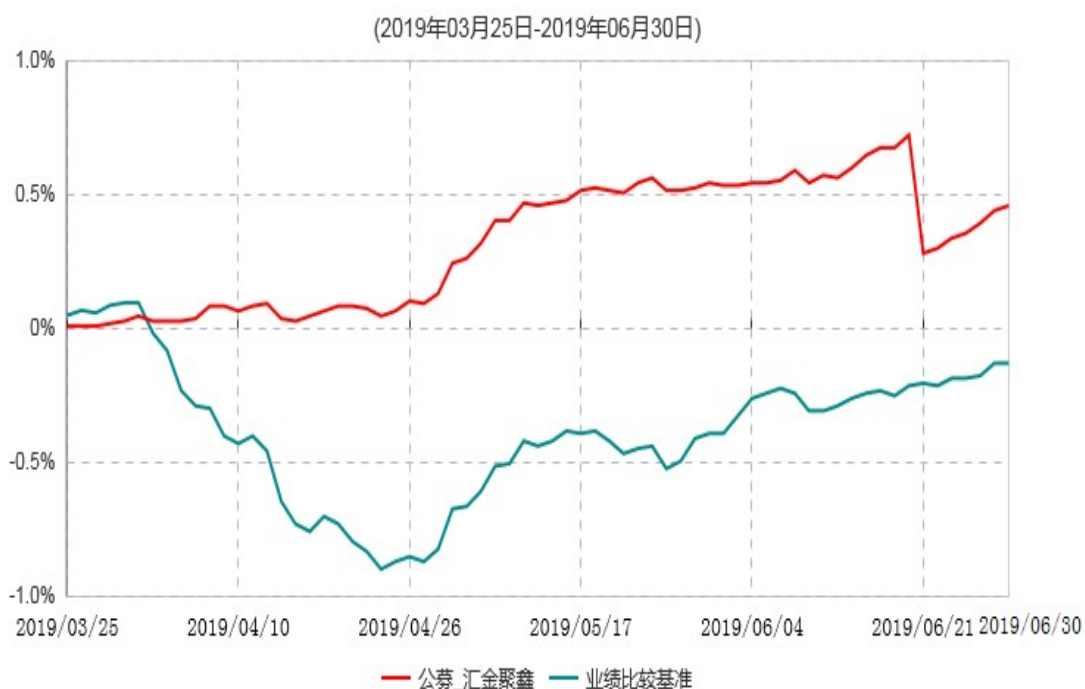
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.42%	0.02%	0.28%	0.03%	0.14%	-0.01%
过去三个月	0.94%	0.03%	-0.24%	0.06%	1.18%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.99%	0.03%	-0.14%	0.06%	1.13%	-0.03%

注：本基金投资的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率

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

浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金自合同生效日2019年3月25日起至披露时点不满一年，本基金至报告期尚未完成建仓。

§ 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

浙江浙商证券资产管理有限公司成立于2013年4月18日，是原浙商证券有限责任公司设立的全资子公司。公司经中国证券监督管理委员会下发的《关于核准浙商证券有限责任公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可（2012）1431号）批准成立，2014年8月19日又经中国证券监督管理委员会下发的《关于核准浙江浙商证券资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可（2014）857号）批准可以从事公募基金管理业务。公司主要经营范围涉及证券资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务。截止2019年6月30日，本基金管理人管理浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金、浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金短债债券型证券投资基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚鑫定期开放

债券型发起式证券投资基金、浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金聚盈中短债债券型证券投资基金。

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		
应洁茜	本基金基金经理, 浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金经理及浙商汇金短债债券型证券投资基金基金经理。	2019-03-25	-	6年	中国国籍, 硕士。2013年加入浙江浙商证券资产管理有限公司, 历任固定收益事业总部交易主管、投资经理助理。现任浙商汇金短债债券型证券投资基金基金经理, 浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金经理及浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式基金基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
范旦波	本基金基金经理, 浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理及浙商汇金聚盈中短债债券型证券投资基金基金经理。	2019-04-08	-	8年	中国国籍, 硕士。历任尼尔森市场研究公司定性研究部高级研究主任、金元顺安有限公司专户债券投资经理、固定收益研究员、招商证券股份有限公司固定收益总部专户投资主管, 2018年11月加入浙商证券资产管理有限公司。

				现任浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理及浙商汇金聚盈中短债债券型证券投资基金基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
--	--	--	--	---

注:1. 上述表格内基金经理的任职日期、离职日期均指公司作出决定并公告披露之日。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

2. 2019年7月23日, 本基金管理人解聘基金经理范旦波女士, 并已按相关规定备案、公告。

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本基金合同的约定, 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, 以确保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规及基金合同的约定。

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

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。

4.3.2 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。

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

回顾上半年，一季度债券市场窄幅震荡，市场对基本面企稳信心不足，叠加权益市场回暖，对债券市场形成一定分流，地方债提前发行也有一定供给压力，市场在多空因素交织的情况下呈震荡行情。二季度债券收益率先上后下。中央政治局会议肯定了一季度经济运行总体平稳、好于预期，市场担忧政策的重心又再度向结构性去杠杆和供给侧结构性改革倾斜。海外经济体增速放缓，中美贸易摩擦继续发酵，避险资产得到追捧。包商银行托管事件对市场流动性扰动较大，流动性分层持续发酵。展望后市，海外需求放缓，PMI继续走弱，通胀压力缓解，中美利差处舒适区间，市场有降准降息预期，均支持债券市场。

本基金在上半年继续增配中短久期利率债、金融债。

感谢投资者的支持，我们将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，努力为持有人获取优异回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商汇金聚鑫定开债基金份额净值为1.0049元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.99%，同期业绩比较基准收益率为-0.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，海外需求整体放缓，多国降息，美联储释放强烈鸽派信号，给予国内货币政策更多空间。国内基建受制隐性债务，地产受制资金链及房价控制，消费整体疲软；贸易摩擦对国内经济影响逐步体现。在利率并轨及支持中小微企业发展的基调下，货币政策大概率维持宽松格局。债券市场不具备走熊基础，利率中枢有望下移，2019年下半年债券市场仍具备投资价值。但流动性分层可能加剧，中高等级债券、利率债受益于无风险利率下移具有更高的投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定及我司估值政策和程序，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。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用

的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 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，本基金未发生《公开募集证券投资基金运行管理办法》的第四十一条所述情形。

§ 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，本基金托管人在对浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金的管理人——浙江浙商证券资产管理有限公司在浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金向份额持有人分配利润2,549,995.49元。

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

本托管人依法对浙江浙商证券资产管理有限公司编制和披露的浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	25,265,762.59
结算备付金		5,564,443.02
存出保证金		31,386.97
交易性金融资产	6.4.7.2	380,495,621.20
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		380,495,621.20
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	199,553,571.84
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	6,655,232.46
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		617,566,018.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年06月30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		104,699,729.20
应付证券清算款		22,450.21
应付赎回款		-

应付管理人报酬		126,425.16
应付托管费		42,141.70
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	18,501.43
应交税费		132.57
应付利息		83,955.14
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	49,521.36
负债合计		105,042,856.77
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	509,999,097.23
未分配利润	6.4.7.10	2,524,064.08
所有者权益合计		512,523,161.31
负债和所有者权益总计		617,566,018.08

注：1、报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0049元，基金份额总额509,999,097.23份。

2、本基金基金合同生效期为2019年3月25日。截止报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
一、收入		6,411,596.79
1. 利息收入		6,185,825.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	362,488.89
债券利息收入		2,611,514.01
资产支持证券利息收入		-

买入返售金融资产收入		3,211,822.46
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-467,340.12
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-467,340.12
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	693,111.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-
减：二、费用		1,337,537.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	407,942.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	135,980.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	6,154.03
5. 利息支出		732,666.62
其中：卖出回购金融资产支出		732,666.62
6. 税金及附加		1,650.54
7. 其他费用	6.4.7.21	53,142.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,074,059.57
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,074,059.57

注：本基金基金合同生效期为2019年3月25日。截止报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06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)	509,999,097.23	-	509,999,097.23
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	5,074,059.57	5,074,059.57
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)	-	-2,549,995.49	-2,549,995.49
五、期末所有者权益 (基金净值)	509,999,097.23	2,524,064.08	512,523,161.31

注：本基金基金合同生效期为2019年3月25日。截止报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

盛建龙

冯建兰

冯建兰

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

浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2018]1724号《关于准予浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》批准,由浙江浙商证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》向社会公开发发行募集。《浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2019年3月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为509,999,097.23份。

相关募集业经北京兴华会计师事务所[2019]京会兴浙分验字第68000010号验资报告予以验证。本基金为债券型证券投资基金,存续期限不定。基金管理人为浙江浙商证券资产管理有限公司,注册登记机构为浙江浙商证券资产管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定而编制。

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于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年3月25日至2019年6月30日的经营成果和基金资产净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制,即自每年1月1日至12月31日为一个会计年度。本报告会计期间为2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（包括交易性金融资产和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）、贷款和应收款项。

金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债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）、其他金融负债。

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

本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1) 贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于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的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1) 按照《企业会计准则第13号—或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第14号—收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金的记账基础为权责发生制。除基金投资、股票投资、债券投资和配股权证按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

每份计划份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的计划份额总额。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于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

1. 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
2. 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；
3. 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在证券回购期内逐日计提；
4. 股票、基金投资收益于卖出股票、基金成交日确认，并按卖出股票、基金成交金额与其成本的差额入账，同时调整公允价值变动损益；
5. 债券投资收益于成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额入账，同时调整公允价值变动损益；
6. 衍生工具投资收益于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账，同时调整公允价值变动损益；
7. 股利收益于除息日确认，并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入账；
8. 公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；
9. 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

1. 管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费；

E 为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

2. 托管人的托管费：

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费；

E 为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

3. 按照国家有关规定可以列入的其他费用

基金合同生效后与基金相关的信息披露费用、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费、基金份额持有人大会费用、基金的证券、期货交易费用、基金的银行汇划费用、基金的账户开户费用、账户维护费用以及按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

4. 基金税收

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2. 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；

3. 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4. 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2016]36号《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《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)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。对基金从上市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。

(4)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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
活期存款	265,762.59
定期存款	25,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	25,000,000.00
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	25,265,762.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	139,804,138.70	140,182,621.20	378,482.50
	银行间市场	239,998,370.95	240,313,000.00	314,629.05
	合计	379,802,509.65	380,495,621.20	693,111.55
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		379,802,509.65	380,495,621.20	693,111.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末，未持有任何衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,000,000.00	-
银行间市场	194,553,571.84	-
合计	199,553,571.84	-

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	1, 207. 62
应收定期存款利息	239, 201. 02
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2, 504. 00
应收债券利息	5, 949, 552. 61
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	462, 753. 11
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	14. 10
合计	6, 655, 232. 46

注：其他为结算保证金应收利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末，未持有其他应收款等其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	18, 501. 43
合计	18, 501. 43

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

预提费用	49,521.36
合计	49,521.36

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	509,999,097.23	509,999,097.23
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	509,999,097.23	509,999,097.23

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

2、本基金合同于2019年3月25日生效，基金合同生效日的基金份额总额为509999097.23份基金份额，其中认购资金利息折合97.23份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,380,948.02	693,111.55	5,074,059.57
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,549,995.49	-	-2,549,995.49
本期末	1,830,952.53	693,111.55	2,524,064.08

注：本基金合同于2019年3月25日生效，无上年度末数据。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06
----	--------------------------------

	月30日
活期存款利息收入	107,227.11
定期存款利息收入	239,201.02
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	15,973.23
其他	87.53
合计	362,488.89

注：其他为结算保证金应收利息。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期末进行股票投资。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金在本报告期末进行基金投资。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年 06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-467,340.12
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	-467,340.12

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑	201,833,996.38

付) 成交总额	
减: 卖出债券 (、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	199,632,912.22
减: 应收利息总额	2,668,424.28
买卖债券差价收入	-467,340.12

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期末未进行资产支持证券投资。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期末未进行贵金属投资。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期末未进行衍生工具投资。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期末未进行衍生工具投资。

6.4.7.17 股利收益

本基金在本报告期内无股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2019年03月25日 (基金合同生效日) 至2019年06月30日
1. 交易性金融资产	693,111.55
——股票投资	-
——债券投资	693,111.55
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	693, 111. 55

6.4.7.19 其他收入

本基金在本报告期无其他收入。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
交易所市场交易费用	204. 03
银行间市场交易费用	5, 950. 00
合计	6, 154. 03

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
审计费用	14, 769. 58
信息披露费	34, 751. 78
汇划手续费	3, 620. 87
合计	53, 142. 23

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

截至本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告披露日，本基金未发生需要披露的日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浙江浙商证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商证券股份有限公司	基金管理人的母公司、本基金销售机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构

注：以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行股票交易。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例

浙商证券股份有限公司	200,614,142.20	100.00%
------------	----------------	---------

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
浙商证券股份有限公司	4,469,825,000.00	100.00%

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。本基金本报告期内无应支付关联方佣金，本报告期末无应支付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	407,942.88
其中：支付销售机构的客户维护费	157,255.07

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从

基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	135,980.92

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

经基金管理人与基金托管人核对一致后，于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期内未通过银行间同业市场与关联方进行债券（含回购）交易。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日
基金合同生效日（2019年03月25日）持有的基金份额	10,000,097.23
报告期初持有的基金份额	10,000,097.23

报告期间申购/买入总 份额	0.00
报告期间因拆分变动份 额	0.00
减：报告期间赎回/卖出 总份额	0.00
报告期末持有的基金份 额	10,000,097.23
报告期末持有的基金份 额占基金总份额比例	1.96%

注：1、上表列示的报告期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，列示的报告期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、本报告期内，基金管理人运用固有资金投资本基金费率与其他投资者执行的费率一致，基金管理人赎回本基金份额的行为遵从《基金管理公司固有资金运用管理暂行规定》的相关规定。

3、本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名 称	本期末 2019年06月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
浙商银行 股份有限 公司（杭 州）	499,999,000.00	98.04%

本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名 称	本期 2019年03月25日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入

浙商银行 股份有限 公司	265,762.59	107,227.11
--------------------	------------	------------

注：1、本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。
2、本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期末未发生其他关联交易事项。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度可比期间数据。

6.4.11 利润分配情况--非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基 金 份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润 分配合计	备注
1	2019-06 -20	2019-06 -20	0.050	2,549,99 5.49	-	2,549,99 5.49	-
合计			0.050	2,549,99 5.49	-	2,549,99 5.49	-

6.4.12 期末（2019年06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

截止本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止本报告期末，本基金未持有股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为47,199,729.20元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
180210	18国开10	2019-07-05	101.58	200,000	20,316,000.00
190202	19国开02	2019-07-05	99.67	300,000	29,901,000.00
合计				500,000	50,217,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为57,500,000.00元，于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金管理人按照全面风险管理的要求，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

公司建立了“董事会-经营管理层-合规风控部”三级风险管理体系，董事会主要负责设定公司的风险偏好和制订风险管理授权体系；公司经营层主要负责执行经董事会批准的风险管理政策；合规风控部具体履行合规与风险管理职能，对各类风险进行评估和动态监控。

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浙商银行，因而与银行存款相关的信用风险较小。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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

本基金本报告期末未持有短期信用评级为A-1及以下或者未评级的债券。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级为A-1及以下或者未评级的资产支持证券。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级为A-1及以下或者未评级的同业存单。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年06月30日
AAA	111,579,000.00
AAA以下	-
未评级	220,630,621.20
合计	332,209,621.20

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。表格中未评级的为国债、国开债等没有评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年06月30日
AAA	48,286,000.00
AAA以下	-
未评级	-

合计	48,286,000.00
----	---------------

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除6.4.12列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2019年06 月30日	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	
银行存款	25,265, 762.59	-	-	-	-	25,265,762.59
结算备付 金	5,564,4 43.02	-	-	-	-	5,564,443.02
存出保证 金	31,386. 97	-	-	-	-	31,386.97
交易性金 融资产	-	-	78,517, 000.00	281,66 2,621.2 0	20,316, 000.00	380,495,621.2 0
买入返售 金融资产	199,55 3,571.8 4	-	-	-	-	199,553,571.8 4
资产总计	230,41 5,164.4 2	-	78,517, 000.00	281,66 2,621.2 0	20,316, 000.00	610,910,785.6 2
负债	-	-	-	-	-	
卖出回购 金融资产	104,69 9,729.2	-	-	-	-	104,699,729.2 0

	0					
负债总计	104,699,729.20	-	-	-	-	104,699,729.20
流动性净额	125,715,435.22	-	78,517,000.00	281,662,621.20	20,316,000.00	506,211,056.42

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为定期开放基金，即以封闭运作和开放运作相交替循环的方式运作。本基金以3个月为一个封闭期，在封闭期内本基金采取封闭运作方式，基金份额持有人不得申购、赎回本基金，也不上市交易。

截止本报告期末，本基金持有的债券资产加权平均剩余期限为2.33年，整体流动性风险可控。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	25,265,762.59	-	-	-	-	-	25,265,762.59
结算备付金	5,564,443.02	-	-	-	-	-	5,564,443.02
存出保证金	31,386.97	-	-	-	-	-	31,386.97
交易性	-	-	78,517,000.00	281,662,621.20	20,316,000.00	-	380,495,621.20

金融资产			0	0	0		0
买入返售金融资产	199,553,571.84	-	-	-	-	-	199,553,571.84
应收利息	-	-	-	-	-	6,655,232.46	6,655,232.46
资产总计	230,415,164.42	-	78,517,000.00	281,662,621.20	20,316,000.00	6,655,232.46	617,566,018.08
负债							
卖出回购金融资产款	104,699,729.20	-	-	-	-	-	104,699,729.20
应付证券清算款	-	-	-	-	-	22,450.21	22,450.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	126,425.16	126,425.16
应付托管费	-	-	-	-	-	42,141.70	42,141.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	18,501.43	18,501.43
应交税费	-	-	-	-	-	132.57	132.57
应付利息	-	-	-	-	-	83,955.14	83,955.14
其他负债	-	-	-	-	-	49,521.36	49,521.36
负债总计	104,699,729.20	-	-	-	-	343,127.57	105,042,856.77
利率敏感度缺口	125,715,435.22	-	78,517,000.00	281,662,621.20	20,316,000.00	6,312,104.89	512,523,161.31

注：上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交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额；
假设	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发

	生变化；	
假设	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2019年06月30日
	1、利率下降25个基点	2, 218, 399. 34
	2、利率上升25个基点	-2, 195, 730. 36

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	置信区间为95%	
	观察期为60天	
分析	风险价值	本期末 2019年06月30日
	风险价值	-328, 457. 33

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日，无上年度末数据。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	380,495,621.20	61.61
	其中：债券	380,495,621.20	61.61
	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	199,553,571.84	32.31
	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	30,830,205.61	4.99
8	其他各项资产	6,686,619.43	1.08
9	合计	617,566,018.08	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

截止本报告期末，本基金未持有股票投资组合。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金未持有港股通股票。

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

截止本报告期末，本基金未持有股票投资组合。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

截止本报告期末，本基金未持有股票投资组合。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

截止本报告期末，本基金未持有股票投资组合。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

截止本报告期末，本基金未持有股票投资组合。

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	1,063,779.20	0.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	331,145,842.00	64.61
	其中：政策性金融债	219,566,842.00	42.84
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	48,286,000.00	9.42
9	其他	-	-
10	合计	380,495,621.20	74.24

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	018006	国开1702	1,244,020	127,014,442.00	24.78
2	1820037	18宁波银行03	400,000	40,920,000.00	7.98
3	111994252	19哈尔滨银行C D029	400,000	38,608,000.00	7.53
4	1828017	18兴业绿色金 融02	300,000	30,369,000.00	5.93
5	100208	10国开08	300,000	30,231,000.00	5.90

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进行贵金属投资。

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

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券中18宁波银行03的发行人宁波银行分别于2019年1月11日和2019年3月22日因未依法履行职责等原因收到监管处罚合计40万元人民币；本基金投资的前十名证券中18民生银行02的发行人民生银行分别于2018年11月9日、2018年12月7日、2019年4月2日、2019年4月3日和2019年4月16日因未依法履行职责等原因收到监管处罚合计3610万元人民币。本基金投资上述债券的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。本基金管理人的投研团队对上述债券发行人受处罚事件进行了及时分析和跟踪研究。认为该事件对该债券的投资价值未产生实质性影响。

7.12.2 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证券库之外的证券。

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	31,386.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,655,232.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,686,619.43

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债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有股票。

§ 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
2	254,999,548.62	509,999,097.23	100.00%	0.00	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的基金从业人员均未持有本基金。

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	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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

8.4 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	10,000,097.23	1.96%	10,000,097.23	1.96%	3年

基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,097.23	1.96%	10,000,097.23	1.96%	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年03月25日)基金份额总额	509,999,097.23
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	509,999,097.23

注：上表列示的总申购份额含红利再投、转换入份额，列示的总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会，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

基金管理人的重大人事变动：2019年2月，浙江浙商证券资产管理有限公司聘任盛建龙先生担任总经理及法定代表人职务，上述人事变动，已按相关规定备案、公告。

基金托管人的专门基金托管部门均无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同成立以来一直聘请北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

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

报告期内基金管理人、托管人的业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

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	
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：a) 本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格，上海证券市场只能使用母公司浙商证券席位进行交易。截至报告期末，本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。本报告期内，交易单元租用浙商证券43595席位、租用国泰君安007682席位进行交易。

b) 本公司作为浙商证券股份有限公司的全资子公司，根据交易所一般要求，优先租用浙商证券的交易单元。本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分

析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
浙商证券	200,614,142.20	100.00%	4,469,825,000.00	100.00%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	100,000.00	0.00%	-	-	-	-

10.8 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	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、公司官网	2019-03-14
2	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金风险评估报告	公司官网	2019-03-14
3	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同	公司官网	2019-03-14
4	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书	证券时报、公司官网	2019-03-14
5	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议	证券时报、公司官网	2019-03-14

6	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同摘要	证券时报、公司官网	2019-03-14
7	浙江浙商证券资产管理有限公司关于浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	证券时报、公司官网	2019-03-20
8	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金2019年基金合同生效公告	证券时报、公司官网	2019-03-26
9	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、公司官网	2019-04-09
10	关于增加诺亚正行基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、公司官网	2019-05-25
11	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	证券时报、公司官网	2019-06-20
12	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	证券时报、公司官网	2019-06-20
13	浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金半年度最后一个市场交易日净值公告	证券时报、公司官网	2019-06-29

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过20%的时间区间					
机构	1	20190325-20190630	0.00	499,999,000.00	0.00	499,999,000.00	98.04%
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情形，在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，存在流动性风险。							

注：本基金的基金合同生效日为2019年3月25日。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准设立浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金的文件；
 《浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
 《浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
 报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
 基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7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询；亦可通过公司网站查阅，公司网址为：
www.stocke.com.cn。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二〇一九年八月二十六日