

# 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金

## 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 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:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2020 年 04 月 29 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。本年度报告已经全部董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年4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。

北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金财务出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2019年06月21日（基金合同生效日）起至2019年12月31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                         | 7  |
| 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、基金净值表现及利润分配情况                 | 8  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 12 |
| §4 管理人报告                                | 13 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 13 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 15 |
| 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             | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 17 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 18 |
| 4.9 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       | 18 |
| §5 托管人报告                                | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 18 |
| 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 | 18 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 19 |
| §6 审计报告                                 | 19 |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 19 |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 19 |
| §7 年度财务报表                               | 22 |
| 7.1 资产负债表                               | 22 |
| 7.2 利润表                                 | 23 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 25 |
| 7.4 报表附注                                | 26 |
| §8 投资组合报告                               | 55 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 55 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 56 |
| 8.3 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       | 56 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 56 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 57 |
| 8.6 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      | 57 |
| 8.7 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   | 58 |
| 8.8 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   | 58 |
| 8.9 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      | 58 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 58 |

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 58 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                      | 58 |
| §9 基金份额持有人信息.....                       | 59 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 59 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 60 |
| 9.3 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.....   | 60 |
| §10 开放式基金份额变动.....                      | 60 |
| §11 重大事件揭示.....                         | 61 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 61 |
| 11.2 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.....   | 61 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 61 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                     | 61 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 61 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 62 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 62 |
| 11.8 其他重大事件.....                        | 63 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 65 |
| 12.1 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..... | 65 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 66 |
| §13 备查文件目录.....                         | 66 |
| 13.1 备查文件目录.....                        | 66 |
| 13.2 存放地点.....                          | 66 |
| 13.3 查阅方式.....                          | 66 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                          |                   |
|-----------------|--------------------------|-------------------|
| 基金名称            | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金 |                   |
| 基金简称            | 浙商汇金中高等级三个月              |                   |
| 基金主代码           | 007425                   |                   |
| 基金运作方式          | 契约型、定期开放式                |                   |
| 基金合同生效日         | 2019年06月21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           | 中国光大银行股份有限公司             |                   |
| 报告期末基金份额总额      | 2,735,224,960.44份        |                   |
| 基金合同存续期         | 不定期                      |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 浙商汇金中高等级三个月A             | 浙商汇金中高等级三个月C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 007425                   | 007442            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 597,441,802.25份          | 2,137,783,158.19份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                       |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                                                                                      |
| 投资策略 | <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，自上而下决定资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。</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、信用债投资策略</p> <p>信用类债券是本基金重要投资标的，因此信用策略是本基金债券投资策略的重要部分。由于影响信用债券利差水平的因素包括市场整体的信用利差水平和信用债自身的信用情况变化，因此本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。</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。本基金将严格控制资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>5、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金将通过分析对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。基金投资证券公司短期公司债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。</p> <p>6、国债期货交易策略</p> <p>基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。</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 | 中债高信用等级债券财富指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

|        |                                            |
|--------|--------------------------------------------|
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，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        | 中国光大银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 方斌                    | 石立平                       |
|         | 联系电话 | 0571-87903297         | 010-63639180              |
|         | 电子邮箱 | fund@stocke.com.cn    | shiliping@cebbank.com     |
| 客户服务电话  |      | 95345                 | 95595                     |
| 传真      |      | 0571-87902581         | 010-63639132              |
| 注册地址    |      | 杭州市下城区天水巷25号          | 北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心 |
| 办公地址    |      | 杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7楼 | 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心      |
| 邮政编码    |      | 310020                | 100033                    |
| 法定代表人   |      | 盛建龙                   | 李晓鹏                       |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                       |
|---------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报                 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.stocke.com.cn     |
| 基金年度报告备置地点          | 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                |
|--------|--------------------|---------------------|
| 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 |
| 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   |

|  |    |      |
|--|----|------|
|  | 公司 | 大楼7楼 |
|--|----|------|

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 本期2019年06月21日（基金合同生效日）－ 2019年12月31日 |                  |
|---------------|-------------------------------------|------------------|
|               | 浙商汇金中高等级三个月A                        | 浙商汇金中高等级三个月C     |
| 本期已实现收益       | 6,469,227.08                        | 20,930,832.59    |
| 本期利润          | 6,823,885.83                        | 22,354,972.91    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0198                              | 0.0186           |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.96%                               | 1.84%            |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.32%                               | 2.19%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019年末                              |                  |
| 期末可供分配利润      | 7,299,882.43                        | 23,281,438.66    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0122                              | 0.0109           |
| 期末基金资产净值      | 607,710,359.00                      | 2,171,685,319.66 |
| 期末基金份额净值      | 1.0172                              | 1.0159           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2019年末                              |                  |
| 基金份额累计净值增长率   | 2.32%                               | 2.19%            |

注：1、本基金合同于2019年06月21日起生效，自合同生效日起至本报告期末不足一年。  
 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

## 浙商汇金中高等级三个月A

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.95%        | 0.01%               | 1.15%              | 0.02%                     | -0.20% | -0.01% |
| 过去六个月          | 2.21%        | 0.02%               | 2.62%              | 0.02%                     | -0.41% | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 2.32%        | 0.02%               | 2.84%              | 0.02%                     | -0.52% | 0.00%  |

注：本基金的业绩比较基准：中债高信用等级债券财富指数收益率。

## 浙商汇金中高等级三个月C

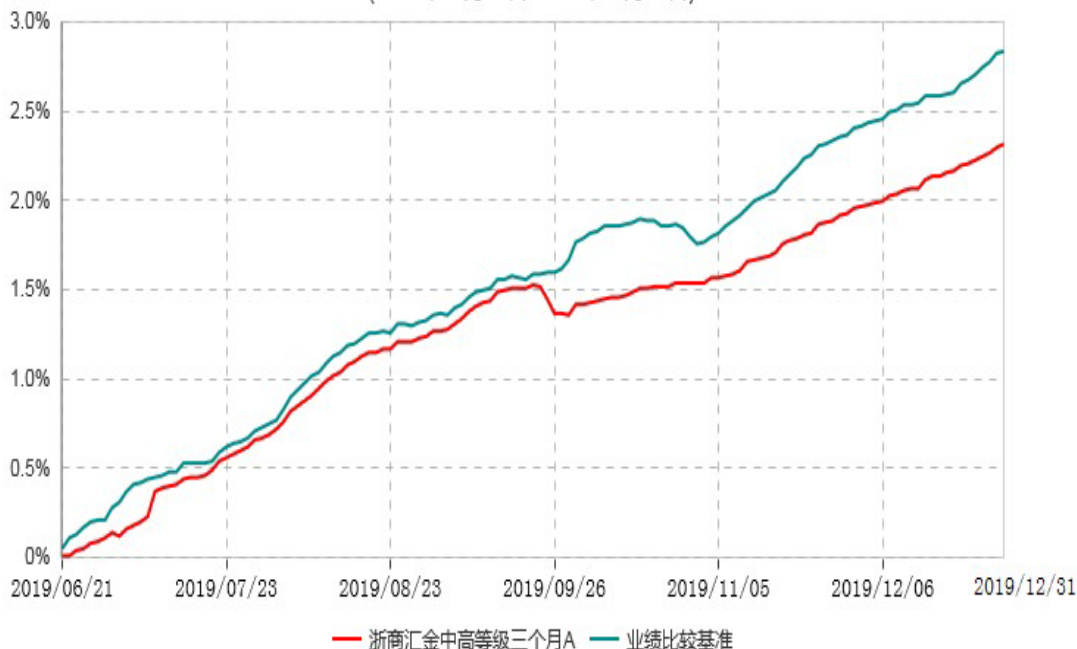
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.88%        | 0.01%               | 1.15%              | 0.02%                     | -0.27% | -0.01% |
| 过去六个月          | 2.09%        | 0.02%               | 2.62%              | 0.02%                     | -0.53% | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 2.19%        | 0.02%               | 2.84%              | 0.02%                     | -0.65% | 0.00%  |

注：本基金的业绩比较基准：中债高信用等级债券财富指数收益率。

### 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

浙商汇金中高等级三个月A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

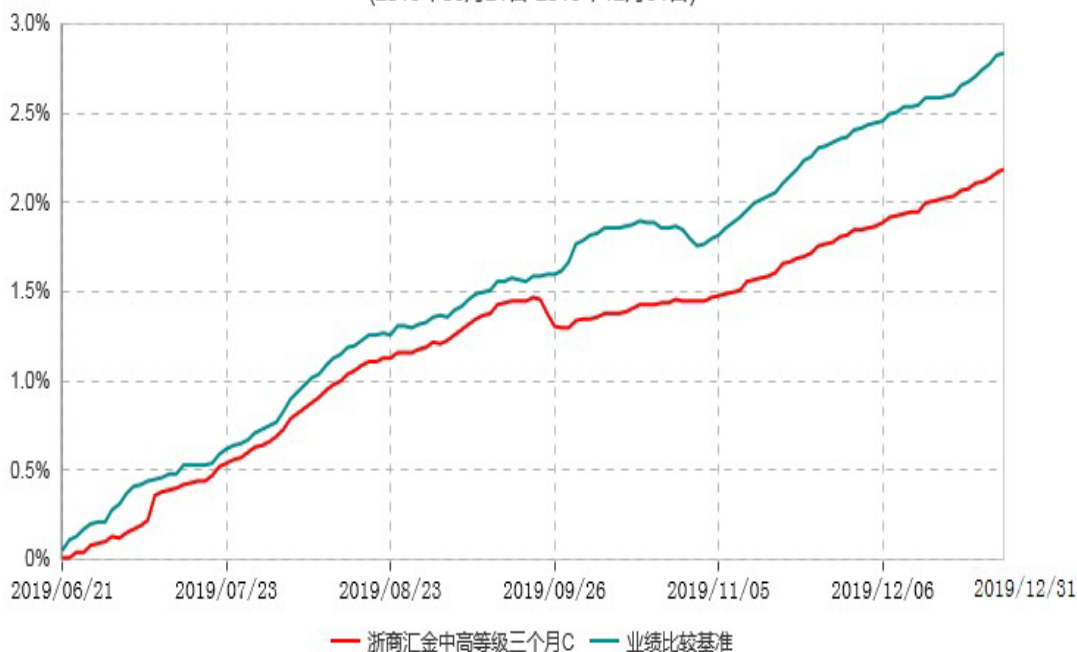
(2019年06月21日-2019年12月31日)



注：本基金自合同生效日 2019 年 6 月 21 日起至报告期末不足一年，至本报告期末本基金已完成建仓，但报告期末距建仓结束不满 1 年。建仓期为 2019 年 6 月 21 日-2019 年 12 月 20 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

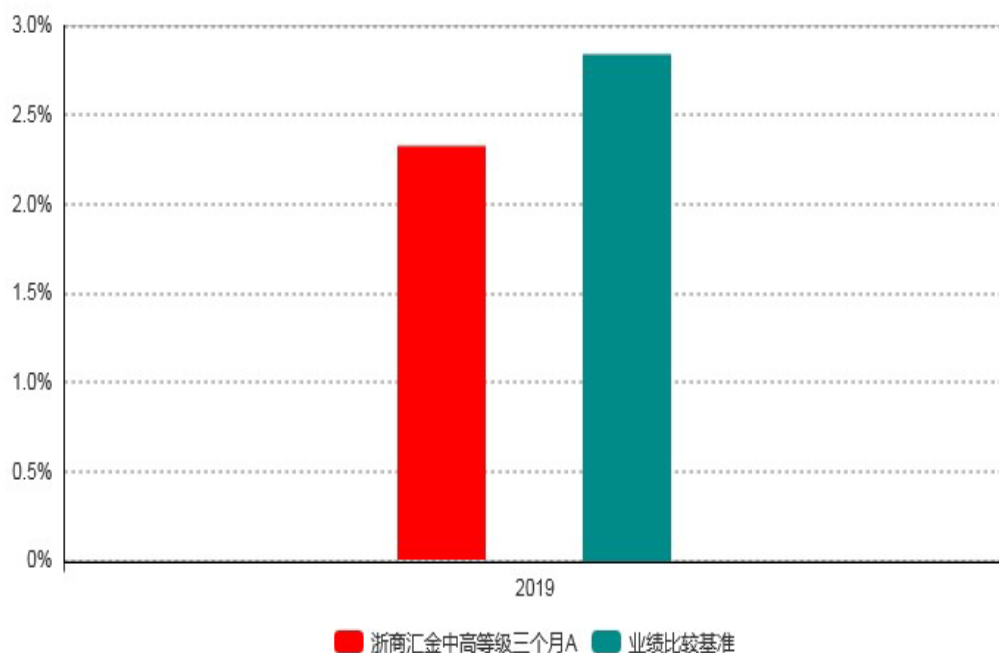
浙商汇金中高等级三个月C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年06月21日-2019年12月31日)

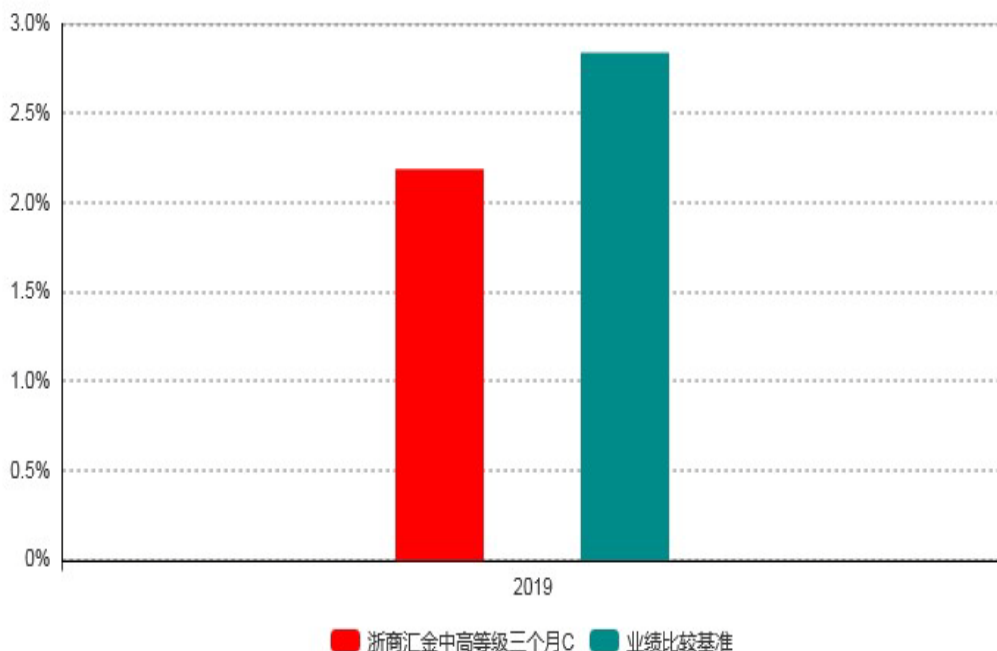


注：本基金自合同生效日 2019 年 6 月 21 日起至报告期末不足一年，至本报告期末本基金已完成建仓，但报告期末距建仓结束不满 1 年。建仓期为 2019 年 6 月 21 日-2019 年 12 月 20 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2019 年 06 月 21 日，基金合同生效当年的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度计算。



注：本基金合同生效日为 2019 年 06 月 21 日，基金合同生效当年的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

浙商汇金中高等级三个月A

单位：人民币元

| 年度    | 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 | 年度利润分配合计   | 备注 |
|-------|-------------|------------|-----------|------------|----|
| 2019年 | 0.060       | 682,365.91 | 37,271.41 | 719,637.32 | —  |
| 合计    | 0.060       | 682,365.91 | 37,271.41 | 719,637.32 | —  |

浙商汇金中高等级三个月C

单位：人民币元

| 年度    | 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 | 年度利润分配合计     | 备注 |
|-------|-------------|--------------|-----------|--------------|----|
| 2019年 | 0.060       | 2,289,370.01 | 22,093.08 | 2,311,463.09 | —  |
| 合计    | 0.060       | 2,289,370.01 | 22,093.08 | 2,311,463.09 | —  |

注：本基金合同生效日为2019年06月21日

## § 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《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，由浙商证券股份有限公司出资12亿元从事资产管理业务。2014年8月19日中国证券监督管理委员会批准《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）。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12月31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、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、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金和浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

#### 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       |        |                                                                               |
| 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、浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式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 | 2019-06-21      | 2019-07-23 | 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 |

|     |                                                                                                                                 |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 金经理。                                                                                                                            |            |   |     | 管，2018年11月加入浙商证券资产管理有限公司。曾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。                                                                          |
| 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、浙商汇金短债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。 | 2019-07-02 | - | 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、浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式基金基金经理、浙商汇金短债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。拥有基金从业资格及证券从业资格。 |

注：上述表格内基金经理的任职日期、离职日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写。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。

## 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，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定制定了公司《公平交易管理办法》。公司公平交易体系涵盖研究分析、投资决策、交易执行、交易监控等投资管理活动相关的各个环节，各环节公平措施简要如下：

公司各投资组合共用研究平台、共享信息，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司接受的外部研究报告、内部研究人员撰写的研究报告对公司各投资组合经理开放。

投资组合经理在授权权限范围内做出投资决策，并负责投资决策的具体实施。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。同时，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度。并在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，即按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，交易系统将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。

公司合规风控部定期对不同投资组合交易情况进行分析，对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

2019年债券市场全年震荡，4月市场对基本面企稳预期升温，国债发行利率远高于二级，降准预期延后、通胀升温等利空因素叠加，货币政策报告重提“把好总闸门”流动性预期边际收紧，收益率明显上行，10年国债上行至全年最高点3.4%附近，而后利空因素逐步缓解，收益率向基本面回归，震荡下行，触碰至3%关键点位后反弹，上行至全年次高点3.2%，而后受货币政策宽松、基金配置力量强劲等因素下行。2019年全年10年期国债收益率在3%-3.4%内。信用债跟随利率曲线震荡，但利差收窄。

报告期内，除可转债一级打新，本基金全部投资中高等级债券，上半年增加产品久期，下半年控制产品久期，稳定产品净值。

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中高等级三个月A基金份额净值为1.0172元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.32%，同期业绩比较基准收益率为2.84%；截至报告期末浙商汇金中高等级三个月C基金份额净值为1.0159元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.19%，同期业绩比较基准收益率为2.84%。

## 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2020年，新冠疫情对各行业影响深远，至少影响经济1-2个季度。2020年是收官之前，稳增长基调强烈，预计将出台更积极的财政政策并营造宽松的货币支持经济发展。债市基本面上半年受疫情影响得以支撑，下半年取决于疫情控制情况及对冲政策力度。在收益率处历史低位的环境下，参与长债风险收益比较低，需及时切换大类资产配置，根据市场环境进行组合投资，提防尾部信用风险，以中高等级债券投资为主。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2019年，本基金管理人内部监察稽核工作坚持规范运作、防范风险、维护投资人利益的原则，在进一步完善、优化公司内控制度的基础上，严格依据法律法规和公司内控

制度监督前后台各部门日常工作，切实防控公司运营和投资组合运作的风险，保障公司稳步发展。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作主要包括以下几个方面：

#### 一、进一步完善、优化公司内控制度，加强监察稽核力度。

报告期间，公司制定了《浙江浙商证券资产管理有限公司风控体系建设实施纲要》、《浙江浙商证券资产管理有限公司固定收益业务信用衍生品投资管理办法》、《浙江浙商证券资产管理有限公司权益类产品投资业务风险管理办法》、《浙江浙商证券资产管理有限公司固定收益公募产品投资管理办法》、《浙江浙商证券资产管理有限公司存款及同业存单投资管理制度》；修订了《浙江浙商证券资产管理有限公司资产管理业务决策委员会议事规则》、《浙江浙商证券资产管理有限公司基金业务会计核算及估值办法》、《浙江浙商证券资产管理有限公司公平交易管理制度》、《浙江浙商证券资产管理有限公司公司集中交易管理办法》、《浙江浙商证券资产管理有限公司资产管理业务权益投资管理办法》。通过新增和修订制度，进一步完善了公司规章制度体系，有效保障了公司相关机构职能的发挥及业务的发展。同时，合规风控部继续严格依据法律法规和公司规章制度独立行使职责，通过定期或不定期检查、专项检查等方式，监督公司各项制度执行情况，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

#### 二、继续加强投资监控，防范投资运作风险。

报告期内，合规风控部通过现场检查、电脑实时监控、人员询问、重点抽查等方式，加强事前、事中、事后的风险管理，同时通过定期对投资组合进行量化风险分析和绩效评估并提供风险分析报告和绩效评估报告等方式进行风险控制，切实贯彻落实公平交易，防范异常交易，确保公司旗下投资组合合法合规运作，切实维护投资人的合法利益。

报告期内，本基金管理人所管理基金的运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，不断完善和优化操作流程，充实和改进内控技术方法与手段，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，防范和控制各种风险，合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《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合同》的约定，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；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相应类别的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该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

本基金对报告期内利润共进行1次收益分配。于2019年09月17日，每10份A类基金份额派发红利0.06元，每10份C类基金份额派发红利0.06元；A类基金份额共计派发红利719,637.32元，C类基金份额共计派发红利2,311,463.09元。

#### 4.9 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，中国光大银行股份有限公司在浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

#### 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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基

金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金2019年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                     |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见               |
| 审计报告编号     | [2020]京会兴审字第04030057号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|         |                                                                                                                                                                                                                                                      |
|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题  | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 审计报告收件人 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                        |
| 审计意见    | 我们认为，汇金中高等级三个月投资基金财务报表在所有重大方面按照财政部于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》编制，公允反映了汇金中高等级三个月投资基金2019年12月31日的财务状况以及2019年6月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日的经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况。 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇金中高等级三个月投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                                      |
| 强调事项            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 其他事项            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 其他信息            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>汇金中高等级三个月投资基金的基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇金中高等级三个月投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算汇金中高等级三个月投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督汇金中高等级三个月投资基金的财务报告过程。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作</p>                                                                                                                                                                       |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-----------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|           | <p>出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三） 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四） 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇金中高等级三个月投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致汇金中高等级三个月投资基金不能持续经营。</p> <p>（五） 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

|           |                     |
|-----------|---------------------|
| 注册会计师的姓名  | 宜军民、 李 鑫            |
| 会计师事务所的地址 | 北京市西城区裕民路18号北环中心22层 |
| 审计报告日期    | 2020-03-18          |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2019年12月31日 |
|----------|---------|--------------------|
| 资 产：     |         |                    |
| 银行存款     | 7.4.7.1 | 895,131.41         |
| 结算备付金    |         | 3,451,740.16       |
| 存出保证金    |         | 78,708.88          |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 1,587,269,183.94   |
| 其中：股票投资  |         | —                  |
| 基金投资     |         | —                  |
| 债券投资     |         | 1,587,269,183.94   |
| 资产支持证券投资 |         | —                  |
| 贵金属投资    |         | —                  |
| 衍生金融资产   | 7.4.7.3 | —                  |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 1,488,314,882.22   |
| 应收证券清算款  |         | —                  |
| 应收利息     | 7.4.7.5 | 26,603,737.69      |
| 应收股利     |         | —                  |
| 应收申购款    |         | —                  |
| 递延所得税资产  |         | —                  |
| 其他资产     | 7.4.7.6 | —                  |
| 资产总计     |         | 3,106,613,384.30   |

| 负债和所有者权益      | 附注号      | 本期末<br>2019年12月31日 |
|---------------|----------|--------------------|
| <b>负 债：</b>   |          |                    |
| 短期借款          |          | —                  |
| 交易性金融负债       |          | —                  |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3  | —                  |
| 卖出回购金融资产款     |          | 323,500,000.00     |
| 应付证券清算款       |          | —                  |
| 应付赎回款         |          | —                  |
| 应付管理人报酬       |          | 1,177,958.52       |
| 应付托管费         |          | 235,591.67         |
| 应付销售服务费       |          | 1,630,120.35       |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | 25,611.25          |
| 应交税费          |          | 344,981.12         |
| 应付利息          |          | 160,942.73         |
| 应付利润          |          | —                  |
| 递延所得税负债       |          | —                  |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 142,500.00         |
| 负债合计          |          | 327,217,705.64     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                    |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 2,735,224,960.44   |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 44,170,718.22      |
| 所有者权益合计       |          | 2,779,395,678.66   |
| 负债和所有者权益总计    |          | 3,106,613,384.30   |

注：(1)本基金基金合同生效日为2019年06月21日，2019年实际报告期间为2019年06月21日至2019年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

(2)报告截止日2019年12月31日，浙商汇金中高等级三个月A基金份额净值1.0172元，基金份额总额597,441,802.25份；浙商汇金中高等级三个月C基金份额净值1.0159元，基金份额总额2,137,783,158.19份。

## 7.2 利润表

会计主体：浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |
|------------------------|------------|------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |            | 37,893,573.12                      |
| 1. 利息收入                |            | 39,852,069.18                      |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 212,060.67                         |
| 债券利息收入                 |            | 22,510,996.76                      |
| 资产支持证券利息收入             |            | 1,155,105.76                       |
| 买入返售金融资产收入             |            | 15,973,905.99                      |
| 其他利息收入                 |            | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -3,752,262.25                      |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -                                  |
| 基金投资收益                 | 7.4.7.13   | -                                  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.14   | -3,429,932.49                      |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.14.3 | -322,329.76                        |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.15   | -                                  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.16   | -                                  |
| 股利收益                   | 7.4.7.17   | -                                  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18   | 1,778,799.07                       |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.19   | 14,967.12                          |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 8,714,714.38                       |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 4,199,138.73                       |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 839,827.69                         |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | 1,630,269.66                       |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.20   | 19,769.18                          |
| 5. 利息支出                |            | 1,827,525.09                       |

|                     |          |               |
|---------------------|----------|---------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 1,827,525.09  |
| 6. 税金及附加            |          | 49,484.03     |
| 7. 其他费用             | 7.4.7.21 | 148,700.00    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 29,178,858.74 |
| 减：所得税费用             |          | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 29,178,858.74 |

注：本基金基金合同生效日为2019年06月21日，2019年实际报告期间为2019年06月21日至2019年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                               | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31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)                   | 505,183,543.13                         | -             | 505,183,543.13   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)          | -                                      | 29,178,858.74 | 29,178,858.74    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 2,230,041,417.31                       | 18,022,959.89 | 2,248,064,377.20 |
| 其中：1. 基金申购款                       | 2,398,227,090.61                       | 19,458,822.20 | 2,417,685,912.81 |
| 2. 基金赎回款                          | -168,185,673.30                        | -1,435,862.31 | -169,621,535.61  |

|                                        |                  |               |                  |
|----------------------------------------|------------------|---------------|------------------|
| 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） | -                | -3,031,100.41 | -3,031,100.41    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,735,224,960.44 | 44,170,718.22 | 2,779,395,678.66 |

注：本基金基金合同生效日为2019年06月21日，2019年实际报告期间为2019年06月21日至2019年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，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7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

盛建龙

盛建龙

盛建龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2019]557号《关于准予浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，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《浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》向社会公开发行募集。《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合同》于2019年6月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为505,183,543.13份，其中A类基金份额为119,939,543.04份，C类基金份额为385,244,000.09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68000024号验资报告予以验证。本基金为契约型定期开放式基金，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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

### 7.4.2 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》、本基金合同的规定而编制。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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12月31日的财务状况以及2019年6月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日的经营成果和基金资产净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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6月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 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三类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融负债在初始确认时划分为以下四类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；（2）金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；（3）不属于上述（1）或（2）的财务担保合同，以及不属于上述（1）并以低于市场利率贷款的贷款承诺；（4）以摊余成本计量的金融负债。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

###### （1）金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

公司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。但是，公司初始确认的应收账款未包含重大融资成分或公司不考虑未超过一年的合同中的融资成分的，按照交易价格进行初始计量。

## (2) 金融资产的后续计量方法

### 1) 以摊余成本计量的金融资产

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。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。

### 2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

采用公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

### 3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

采用公允价值进行后续计量。获得的股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

### 4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

采用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。

## (3) 金融负债的后续计量方法

### 1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此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。对于此类金融负债以公允价值进行后续计量。因公司自身信用风险变动引起的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公允价值变动金额计入其他综合收益，除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配。此类金融负债产生的其他利得或损失（包括利息费用、除因公司自身信用风险变动引起的公允价值变动）计入当期损益，除非该金融负债属于套期关系的一部分。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

### 2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债

按照《企业会计准则第23号—金融资产转移》相关规定进行计量。

### 3) 不属于上述1)或2)的财务担保合同，以及不属于上述1)并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 按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；② 初始确认金额扣除按照相关规定所确定的累计摊销额后的余额。

### 4) 以摊余成本计量的金融负债

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负债所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销时计入当期损益。

#### (4) 金融资产和金融负债的终止确认

1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

② 金融资产已转移，且该转移满足《企业会计准则第23号——金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

2) 当金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除时，相应终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### 3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，继续确认所转移的金融资产。公司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的，分别下列情况处理：（1）未保留对该金融资产控制的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；（2）保留了对该金融资产控制的，按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）所转移金融资产在终止确认日的账面价值；（2）因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）之和。转移了金融资产的一部分，且该被转移部分整体满足终止确认条件的，将转移前金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和继续确认部分之间，按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）终止确认部分的账面价值；（2）终止确认部分的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）之和。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；对在交易所上市的可转换债券，选取每日收盘价作为 对在交易所上市的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券

行机构影响券价格的重大事件或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

(3) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券（包括资产支持证券），采用估值技术确定公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(4) 已经发行未上市期间的债券按以下原则处理

1) 交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。

2) 对银行间市场未上市，且第三方未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用成本估值。

3) 分离交易可转债，上市日前，按未上市有价证券估值原则分别对债券和获配的权证进行估值；自上市日起，债券和获配的权证按上市有价证券估值原则进行估值。

3、全国银行间债券市场交易固定收益品种按以下原则进行估值：对银行间市场上不含权的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价。对银行间市场上含权的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

4、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、采用全价交易的可交换债券比照可转换债券的估值方法估值，采用净价交易的可交换债，选取每日收盘价作为估值净价。

7、国债期货合约按照结算价估值，如估值日无结算价且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日结算价估值。

8、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

9、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

10、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

11、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

每份基金份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的基金份额总额。

#### 7.4.4.8 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/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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第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、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

##### 2、基金托管人的托管费

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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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第2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

##### 3、基金销售服务费

基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日C类基金资产净值的销售服务年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{销售服务年费率} \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，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第2-5个工作日内从基金财产中一次性划出，由基金管理人根据相关协议分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 4. 按照国家有关规定可以列入的其他费用

本基金存续期间发生的信息披露费，与基金资产相关的会计师审计费和律师费、基金资产终止时的清算费用以及按照管理合同及国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据其他相关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金资产费用。

#### 5. 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。

### 7.4.4.11 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、投资者的现金红利保留到小数点后第2位，此误差产生的收益或损失由基金财产承担；

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年3月31日分别发布了《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量（2017年修订）》（财会〔2017〕7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移（2017年修订）》（财会〔2017〕8号）、《企业会计准则第24号—套期会计（2017年修订）》

（财会〔2017〕9号），于2017年5月2日发布了《企业会计准则第37号--金融工具列报（2017年修订）》（财会〔2017〕14号）（上述准则统称“新金融工具准则”），要求境内上市企业自2019年1月1日起执行新金融工具准则。

经本基金管理人母公司浙商证券第三届董事会第五次会议决议通过，本公司于2019年1月1日起开始执行前述新金融工具准则。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2019年12月31日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 895,131.41         |
| 定期存款         | —                  |
| 其中：存款期限1个月以内 | —                  |
| 存款期限1-3个月    | —                  |
| 存款期限3个月以上    | —                  |
| 其他存款         | —                  |
| 合计           | 895,131.41         |

注：本基金合同生效日为2019年6月21日，无上年度末数据。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末2019年12月31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 | 543,049,484.00   | 541,458,183.94   | -1,591,300.06 |
|               | 银行间市场 | 1,042,440,900.87 | 1,045,811,000.00 | 3,370,099.13  |
|               | 合计    | 1,585,490,384.87 | 1,587,269,183.94 | 1,778,799.07  |
| 资产支持证券        |       | -                | -                | -             |
| 基金            |       | -                | -                | -             |
| 其他            |       | -                | -                | -             |
| 合计            |       | 1,585,490,384.87 | 1,587,269,183.94 | 1,778,799.07  |

注：本基金合同生效日为2019年6月21日，无上年度末数据。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末，未持有衍生金融资产/负债。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度末数据。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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12月31日   |           |
|-------|------------------|-----------|
|       | 账面余额             | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 420,170,000.00   | -         |
| 银行间市场 | 1,068,144,882.22 | -         |
| 合计    | 1,488,314,882.22 | -         |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度末数据。

##### 7.4.7.4.2 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，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度末数据。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019年12月31日 |
|----|--------------------|
|----|--------------------|

|            |               |
|------------|---------------|
| 应收活期存款利息   | 3,854.66      |
| 应收定期存款利息   | —             |
| 应收其他存款利息   | —             |
| 应收结算备付金利息  | 1,708.63      |
| 应收债券利息     | 17,950,585.13 |
| 应收资产支持证券利息 | —             |
| 应收买入返售证券利息 | 8,647,550.33  |
| 应收申购款利息    | —             |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —             |
| 其他         | 38.94         |
| 合计         | 26,603,737.69 |

注：本基金合同生效日为2019年6月21日，无上年度末对比数据。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末，未持有其他资产。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度末数据。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | —                  |
| 银行间市场应付交易费用 | 25,611.25          |
| 合计          | 25,611.25          |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度末数据。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                  |
| 应付赎回费       | —                  |

|      |            |
|------|------------|
| 预提费用 | 142,500.00 |
| 合计   | 142,500.00 |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度末数据。

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 浙商汇金中高等级三个月A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(浙商汇金中高等级三个月A) | 本期2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |                |
|----------------------|------------------------------------|----------------|
|                      | 基金份额（份）                            | 账面金额           |
| 基金合同生效日              | 119,939,543.04                     | 119,939,543.04 |
| 本期申购                 | 511,982,211.69                     | 511,982,211.69 |
| 本期赎回（以“-”号填列）        | -34,479,952.48                     | -34,479,952.48 |
| 本期末                  | 597,441,802.25                     | 597,441,802.25 |

##### 7.4.7.9.2 浙商汇金中高等级三个月C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(浙商汇金中高等级三个月C) | 本期2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |                  |
|----------------------|------------------------------------|------------------|
|                      | 基金份额（份）                            | 账面金额             |
| 基金合同生效日              | 385,244,000.09                     | 385,244,000.09   |
| 本期申购                 | 1,886,244,878.92                   | 1,886,244,878.92 |
| 本期赎回（以“-”号填列）        | -133,705,720.82                    | -133,705,720.82  |
| 本期末                  | 2,137,783,158.19                   | 2,137,783,158.19 |

注：（1）本基金合同生效日为2019年6月21日，无上年度同期对比数据。基金合同生效日的基金份额总额为505,183,543.13份基金份额，其中认购资金利息折合33,446.83份基金份额。

（2）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 浙商汇金中高等级三个月A

单位：人民币元

| 项目<br>(浙商汇金中高等级三<br>个月A) | 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                     | 6,469,227.08 | 354,658.75   | 6,823,885.83  |
| 本期基金份额交易产<br>生的变动数       | 1,550,292.67 | 2,614,015.57 | 4,164,308.24  |
| 其中：基金申购款                 | 1,659,777.26 | 2,813,117.23 | 4,472,894.49  |
| 基金赎回款                    | -109,484.59  | -199,101.66  | -308,586.25   |
| 本期已分配利润                  | -719,637.32  | -            | -719,637.32   |
| 本期末                      | 7,299,882.43 | 2,968,674.32 | 10,268,556.75 |

#### 7.4.7.10.2 浙商汇金中高等级三个月C

单位：人民币元

| 项目<br>(浙商汇金中高等级三<br>个月C) | 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                     | 20,930,832.59 | 1,424,140.32  | 22,354,972.91 |
| 本期基金份额交易产<br>生的变动数       | 4,662,069.16  | 9,196,582.49  | 13,858,651.65 |
| 其中：基金申购款                 | 4,993,959.32  | 9,991,968.39  | 14,985,927.71 |
| 基金赎回款                    | -331,890.16   | -795,385.90   | -1,127,276.06 |
| 本期已分配利润                  | -2,311,463.09 | -             | -2,311,463.09 |
| 本期末                      | 23,281,438.66 | 10,620,722.81 | 33,902,161.47 |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度末数据。

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |
|----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 184,381.44                         |

|           |            |
|-----------|------------|
| 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 | 27,349.23  |
| 其他        | 330.00     |
| 合计        | 212,060.67 |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.7.12 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。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金在本报告期末进行基金投资。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31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 | -3,429,932.49                          |
| 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                            | -3,429,932.49                          |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |
|-------------------------|----------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,379,877,401.86                       |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,360,401,723.80                       |
| 减：应收利息总额                | 22,905,610.55                          |
| 买卖债券差价收入                | -3,429,932.49                          |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |
|----------------|----------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 41,978,220.38                          |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 40,322,327.67                          |
| 减：应收利息总额       | 1,978,222.47                           |
| 资产支持证券投资收益     | -322,329.76                            |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末进行贵金属投资。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末进行权证投资。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期未进行其他衍生工具投资。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

**7.4.7.17 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |
|------------------------|----------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 1,778,799.07                           |
| ——股票投资                 | —                                      |
| ——债券投资                 | 1,778,799.07                           |
| ——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                     | 1,778,799.07                           |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

**7.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|         | 日         |
|---------|-----------|
| 基金赎回费收入 | 14,967.12 |
| 合计      | 14,967.12 |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31<br>日 |
|-----------|--------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 3,094.18                                   |
| 银行间市场交易费用 | 16,675.00                                  |
| 合计        | 19,769.18                                  |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31<br>日 |
|-------|--------------------------------------------|
| 审计费用  | 42,500.00                                  |
| 信息披露费 | 100,000.00                                 |
| 其他    | 6,200.00                                   |
| 合计    | 148,700.00                                 |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称          | 与本基金的关系             |
|----------------|---------------------|
| 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   |
| 中国光大银行股份有限公司   | 基金托管人、本基金销售机构       |
| 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 |

注：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。以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内未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06月21日，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内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06月21日，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |              |
|------------|----------------------------------------|--------------|
|            | 成交金额                                   | 占当期债券成交总额的比例 |
| 浙商证券股份有限公司 | 932,907,584.65                         | 100.00%      |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31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 | 6,146,990,000.00 | 100.00% |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末无应付关联方佣金余额。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |
|-----------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,199,138.73                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,071,932.42                           |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |
|----------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 839,827.69                             |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%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、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 本期<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |              |              |
|----------------------------|----------------------------------------|--------------|--------------|
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                       |              |              |
|                            | 浙商汇金中高等级三个月A                           | 浙商汇金中高等级三个月C | 合计           |
| 浙商证券                       | 0.00                                   | 35,547.08    | 35,547.08    |
| 光大银行                       | 0.00                                   | 1,604,634.19 | 1,604,634.19 |
| 合计                         | 0.00                                   | 1,640,181.27 | 1,640,181.27 |

注：本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。销售服务费的计提方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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划出，由基金管理人根据相关协议分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易的情况。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人在本报告期间内未运用固有资金投资本基金。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

**7.4.10.4.2 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**

本报告期末未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

**7.4.10.5 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<br>2019年06月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |            |
|--------------|----------------------------------------|------------|
|              | 期末余额                                   | 当期利息收入     |
| 中国光大银行股份有限公司 | 895,131.41                             | 184,381.44 |

注：（1）本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

（2）本基金的基金合同生效日为2019年06月21日，无上年度可比期间数据。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在承销期内无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06月21日，无上年度可比期间数据。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金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06月21日，无上年度可比期间数据。

**7.4.11 利润分配情况—非货币市场基金**

浙商汇金中高等级三个月A

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日 | 除息日      | 每10份基金<br>份额分红数 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润<br>分配合计 | 备注 |
|----|-----------|----------|-----------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 1  | 2019-0    | 2019-09- | 0.060           | 682,365.     | 37,271.41     | 719,637.     | -  |

|    |      |    |       |            |           |            |   |
|----|------|----|-------|------------|-----------|------------|---|
|    | 9-17 | 17 |       | 91         |           | 32         |   |
| 合计 |      |    | 0.060 | 682,365.91 | 37,271.41 | 719,637.32 | - |

浙商汇金中高等级三个月C

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日  | 除息日        | 每10份基金<br>份额分红数 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润<br>分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|-----------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 1  | 2019-09-17 | 2019-09-17 | 0.060           | 2,289,370.01 | 22,093.08     | 2,311,463.09 | -  |
| 合计 |            |            | 0.060           | 2,289,370.01 | 22,093.08     | 2,311,463.09 | -  |

#### 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：债券 |          |               |            |                |          |                |                  |                |                |    |
|----------------------|----------|---------------|------------|----------------|----------|----------------|------------------|----------------|----------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购<br>日 | 可流<br>通日   | 流通<br>受限<br>类型 | 认购<br>价格 | 期末<br>估值<br>单价 | 数量<br>（单<br>位：张） | 期末<br>成本<br>总额 | 期末<br>估值<br>总额 | 备注 |
| 110065               | 淮矿转债     | 2019-12-25    | 2020-01-13 | 未上市            | 100.00   | 100.00         | 1,680            | 168,000.00     | 168,000.00     | -  |
| 113029               | 明阳转债     | 2019-12-18    | 2020-01-07 | 未上市            | 100.00   | 100.00         | 1,890            | 189,000.00     | 189,000.00     | -  |
| 113030               | 东风转债     | 2019-12-26    | 2020-01-20 | 未上市            | 100.00   | 100.00         | 270              | 27,000.00      | 27,000.00      | -  |
| 113554               | 仙鹤转债     | 2019-12-18    | 2020-01-10 | 未上市            | 100.00   | 100.00         | 1,090            | 109,000.00     | 109,000.00     | -  |
| 128084               | 木森转债     | 2019-12-      | 2020-01-   | 未上市            | 100.00   | 100.00         | 2,370            | 237,000.00     | 237,000.00     | -  |

|            |          |                    |                    |         |            |            |       |                    |                    |   |
|------------|----------|--------------------|--------------------|---------|------------|------------|-------|--------------------|--------------------|---|
|            |          | 18                 | 10                 |         |            |            |       | 00                 | 00                 |   |
| 1280<br>85 | 鸿达<br>转债 | 2019<br>-12-<br>18 | 2020<br>-01-<br>08 | 未上<br>市 | 100.<br>00 | 100.<br>00 | 3,040 | 304,<br>000.<br>00 | 304,<br>000.<br>00 | - |
| 1280<br>86 | 国轩<br>转债 | 2019<br>-12-<br>19 | 2020<br>-01-<br>10 | 未上<br>市 | 100.<br>00 | 100.<br>00 | 1,830 | 183,<br>000.<br>00 | 183,<br>000.<br>00 | - |

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31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323,500,000.00元，于2020年1月2日、2020年1月6日、2020年1月7日、2020年1月8日、2020年1月9日、2020年1月13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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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光大银行，因而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，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均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，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 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<br>2019年12月31日 |
|--------|--------------------|
| A-1    | 300,548,000.00     |
| A-1以下  | —                  |
| 未评级    | —                  |
| 合计     | 300,548,000.00     |

注：本基金自2019年6月21日起基金合同生效，上年度末数据无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金自2019年6月21日起基金合同生效，上年度末数据无。本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金自2019年6月21日起基金合同生效，上年度末数据无。本基金本报告期末未持有同业存单。

#### 7.4.13.2.4 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<br>2019年12月31日 |
|--------|--------------------|
| AAA    | 632,036,091.74     |
| AAA以下  | 143,402,092.20     |

|     |                |
|-----|----------------|
| 未评级 | —              |
| 合计  | 775,438,183.94 |

注：本基金自2019年6月21日起基金合同生效，上年度末数据无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金自2019年6月21日起基金合同生效，上年度末数据无。本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金自2019年6月21日起基金合同生效，上年度末数据无。本基金本报告期末未持有同业存单。

#### 7.4.13.3 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7.4.12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。

#### 7.4.13.3.1 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<br>2019年12月<br>31日 | 1个月以<br>内      | 1-3个月          | 3个月<br>-1年     | 1-5年           | 5年以上 | 合计               |
|------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------|------------------|
| 资产                     | —              | —              | —              | —              | —    |                  |
| 银行存款                   | 895,131.41     | —              | —              | —              | —    | 895,131.41       |
| 结算备付金                  | 3,451,740.16   | —              | —              | —              | —    | 3,451,740.16     |
| 存出保证金                  | 78,708.88      | —              | —              | —              | —    | 78,708.88        |
| 交易性金融资产                | 140,317,000.00 | 190,717,000.00 | 789,575,683.94 | 466,659,500.00 | —    | 1,587,269,183.94 |
| 买入返售金                  | 1,488,31       | —              | —              | —              | —    | 1,488,31         |

|           |                  |                |                |                |   |                  |
|-----------|------------------|----------------|----------------|----------------|---|------------------|
| 融资产       | 4,882.22         |                |                |                |   | 4,882.22         |
| 资产总计      | 1,633,057,462.67 | 190,717,000.00 | 789,575,683.94 | 466,659,500.00 | - | 3,080,009,646.61 |
| 负债        | -                | -              | -              | -              | - |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 323,500,000.00   | -              | -              | -              | - | 323,500,000.00   |
| 负债总计      | 323,500,000.00   | -              | -              | -              | - | 323,500,000.00   |
| 流动性净额     | 1,309,557,462.67 | 190,717,000.00 | 789,575,683.94 | 466,659,500.00 | - | 2,756,509,646.61 |

注：本基金自2019年6月21日起基金合同生效，上年度末数据无。

#### 7.4.13.3.2 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在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的合规风控部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年<br>12月31 | 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 |
|-----------------------|-------|-------|--------|------|------|-----|----|
|                       |       |       |        |      |      |     |    |

浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金 2019 年年度报告

|           |                  |                |                |                |   |               |                  |
|-----------|------------------|----------------|----------------|----------------|---|---------------|------------------|
| 日         |                  |                |                |                |   |               |                  |
| 资产        |                  |                |                |                |   |               |                  |
| 银行存款      | 895,131.41       | -              | -              | -              | - | -             | 895,131.41       |
| 结算备付金     | 3,451,740.16     | -              | -              | -              | - | -             | 3,451,740.16     |
| 存出保证金     | 78,708.88        | -              | -              | -              | - | -             | 78,708.88        |
| 交易性金融资产   | 140,317,000.00   | 190,717,000.00 | 789,575,683.94 | 466,659,500.00 | - | -             | 1,587,269,183.94 |
| 买入返售金融资产  | 1,488,314,882.22 | -              | -              | -              | - | -             | 1,488,314,882.22 |
| 应收利息      | -                | -              | -              | -              | - | 26,603,737.69 | 26,603,737.69    |
| 资产总计      | 1,633,057,462.67 | 190,717,000.00 | 789,575,683.94 | 466,659,500.00 | - | 26,603,737.69 | 3,106,613,384.30 |
| 负债        |                  |                |                |                |   |               |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 323,500,000.00   | -              | -              | -              | - | -             | 323,500,000.00   |
| 应付管理人报酬   | -                | -              | -              | -              | - | 1,177,958.52  | 1,177,958.52     |
| 应付托管费     | -                | -              | -              | -              | - | 235,591.67    | 235,591.67       |
| 应付销售服务费   | -                | -              | -              | -              | - | 1,630,120.35  | 1,630,120.35     |
| 应付交易费用    | -                | -              | -              | -              | - | 25,611.25     | 25,611.25        |
| 应交税费      | -                | -              | -              | -              | - | 344,981.12    | 344,981.12       |
| 应付利息      | -                | -              | -              | -              | - | 160,942.73    | 160,942.73       |
| 其他负债      | -                | -              | -              | -              | - | 142,500.00    | 142,500.00       |
| 负债总计      | 323,500,000.00   | -              | -              | -              | - | 3,717,705.64  | 327,217,705.64   |
| 利率敏感度缺口   | 1,309,557,462.67 | 190,717,000.00 | 789,575,683.94 | 466,659,500.00 | - | 22,886,032.05 | 2,779,395,678.66 |

注:1、本基金自2019年6月21日起基金合同生效,上年度末数据无。

2、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。

#### 7.4.13.4.1.2 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<br>2019年12月31日          |
|    | 利率下降25个基点                                                      | 3,662,878.76                |
|    | 利率上升25个基点                                                      | -3,535,729.30               |

注:本基金自2019年6月21日起基金合同生效,上年度末数据无。

#### 7.4.13.4.2 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,因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险,主要是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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019年12月31日 |        |
|----|--------------------|--------|
|    | 公允价值               | 占基金资产净 |

|               |                      | 值比例 (%) |
|---------------|----------------------|---------|
| 交易性金融资产—股票投资  | —                    | —       |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                    | —       |
| 交易性金融资产—债券投资  | 1, 587, 269, 183. 94 | 57. 11  |
| 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            | 1, 587, 269, 183. 94 | 57. 11  |

注:本基金自2019年6月21日起基金合同生效, 上年度末数据无。

#### 7.4.13.4.3.2 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。本基金自2019年6月21日起基金合同生效, 上年度末数据无。

#### 7.4.13.4.4 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<br>2019年12月31日 |
|    | 风险价值     | -221, 322. 37      |

注:本基金自2019年6月21日起基金合同生效, 上年度末数据无。

#### 7.4.14 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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            | 1,587,269,183.94 | 51.09         |
|    | 其中：债券             | 1,587,269,183.94 | 51.09         |
|    | 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          | 1,488,314,882.22 | 47.91         |
|    | 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      | 4,346,871.57     | 0.14          |
| 8  | 其他各项资产            | 26,682,446.57    | 0.86          |
| 9  | 合计                | 3,106,613,384.30 | 100.00        |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资组合。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

## 8.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

本基金本报告期内未买入股票。

### 8.4.2 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

本基金本报告期内未卖出股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票买卖。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -             |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 50,195,000.00    | 1.81          |
|    | 其中：政策性金融债 | -                | -             |
| 4  | 企业债券      | 528,155,007.64   | 19.00         |
| 5  | 企业短期融资券   | 811,831,000.00   | 29.21         |
| 6  | 中期票据      | 183,785,000.00   | 6.61          |
| 7  | 可转债(可交换债) | 13,303,176.30    | 0.48          |
| 8  | 同业存单      | -                | -             |
| 9  | 其他        | -                | -             |
| 10 | 合计        | 1,587,269,183.94 | 57.11         |

### 8.6 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  | 136022    | 15东吴债       | 780,000 | 78,686,400.00 | 2.83          |
| 2  | 071900114 | 19东北证券CP007 | 700,000 | 70,098,000.00 | 2.52          |
| 3  | 122450    | 15齐鲁债       | 680,000 | 68,584,800.00 | 2.47          |
| 4  | 112296    | 15东北债       | 500,000 | 50,658,500.00 | 1.82          |
| 5  | 155240    | 19华泰G1      | 500,000 | 50,330,000.00 | 1.81          |

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，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。

8.12.2 本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 本基金本报告期末未持有股票。

### 8.12.3 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   | 78,708.88     |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 26,603,737.69 |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 26,682,446.57 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.12.6 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，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别       | 持有<br>人户<br>数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>份额<br>比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 浙商<br>汇金<br>中高 | 1,683                | 354,986.22    | 178,664,278.11 | 29.90%         | 418,777,524.14 | 70.10%     |

|                              |        |            |                |       |                  |         |
|------------------------------|--------|------------|----------------|-------|------------------|---------|
| 等级<br>三个月A                   |        |            |                |       |                  |         |
| 浙商<br>汇金<br>中高<br>等级<br>三个月C | 11,446 | 186,771.20 | 0.00           | 0.00% | 2,137,783,158.19 | 100.00% |
| 合计                           | 13,129 | 208,334.60 | 178,664,278.11 | 6.53% | 2,556,560,682.33 | 93.47%  |

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，本基金管理人的从业人员均未持有本基金。

## 9.3 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 | 浙商汇金中高等级三个月A | 0                 |
|                                | 浙商汇金中高等级三个月C | 0                 |
|                                | 合计           | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 浙商汇金中高等级三个月A | 0                 |
|                                | 浙商汇金中高等级三个月C | 0                 |
|                                | 合计           | 0                 |

注：本报告期末，本基金管理人的高级管理人员，基金投资部门及研究部门负责人，本基金的基金经理均未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 浙商汇金中高等级三个月A   | 浙商汇金中高等级三个月C     |
|----------------------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日(2019年06月21日)基金份额总额 | 119,939,543.04 | 385,244,000.09   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额      | 511,982,211.69 | 1,886,244,878.92 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额    | 34,479,952.48  | 133,705,720.82   |
| 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               | 597,441,802.25 | 2,137,783,158.19 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

2019年10月，路迹女士因工作调动，辞去副总经理职务。上述人事变动，已按相关规定备案、公告。

基金托管人的重大人事变动：2019年11月，中国光大银行股份有限公司聘任刘金先生担任中国光大银行股份有限公司行长。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 11.5 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，本报告年度的审计费用为42,500元。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 |    |
| 华创证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 浙商证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

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，本基金交易单元无变更。

b) 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要；
- 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、个股分析报告及丰富全面的信息；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。

### 11.7.2 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 |
| 华创证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 浙商证券 | 932,907,584.65 | 100.00%      | 6,146,990,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

### 11.8 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  | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议     | 中国证监会指定媒介 | 2019-05-23 |
| 2  | 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合同     | 中国证监会指定媒介 | 2019-05-23 |
| 3  | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书    | 中国证监会指定媒介 | 2019-05-23 |
| 4  | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型基金风险评估报告       | 中国证监会指定媒介 | 2019-05-23 |
| 5  | 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合同摘要   | 中国证监会指定媒介 | 2019-05-23 |
| 6  | 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份额发售公告 | 中国证监会指定媒介 | 2019-05-23 |
| 7  | 关于增加诺亚正行基金销售                     | 中国证监会指定媒介 | 2019-05-25 |

|    |                                              |           |            |
|----|----------------------------------------------|-----------|------------|
|    | 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                   |           |            |
| 8  | 关于增加扬州国信嘉利基金销售有限公司为旗下部分公募基金销售机构并参与其费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定媒介 | 2019-06-01 |
| 9  | 关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下部分公募基金销售机构的公告             | 中国证监会指定媒介 | 2019-06-01 |
| 10 | 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合同生效公告             | 中国证监会指定媒介 | 2019-06-22 |
| 11 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金半年度最后一个市场交易日净值公告     | 中国证监会指定媒介 | 2019-06-29 |
| 12 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金半年度最后一个市场自然日净值公告     | 中国证监会指定媒介 | 2019-07-01 |
| 13 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金增聘基金经理公告             | 中国证监会指定媒介 | 2019-07-03 |
| 14 | 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变更公告             | 中国证监会指定媒介 | 2019-07-24 |
| 15 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金分红公告                 | 中国证监会指定媒介 | 2019-09-17 |
| 16 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告        | 中国证监会指定媒介 | 2019-09-19 |

|    |                                                          |           |            |
|----|----------------------------------------------------------|-----------|------------|
| 17 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金暂停大额申购公告                         | 中国证监会指定媒介 | 2019-09-26 |
| 18 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金恢复大额申购公告                         | 中国证监会指定媒介 | 2019-09-27 |
| 19 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金 2019 年第三季度报告                    | 中国证监会指定媒介 | 2019-10-23 |
| 20 | 浙江浙商证券资产管理有限公司副总经理离任公告                                   | 中国证监会指定媒介 | 2019-10-30 |
| 21 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2019 年第 1 号）       | 中国证监会指定媒介 | 2019-12-26 |
| 22 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2019 年第 1 号）           | 中国证监会指定媒介 | 2019-12-26 |
| 23 | 浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议                             | 中国证监会指定媒介 | 2019-12-26 |
| 24 | 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合同                             | 中国证监会指定媒介 | 2019-12-26 |
| 25 | 浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告 | 中国证监会指定媒介 | 2019-12-26 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，本公司于报告期内对基金合同、托管协议和招募说明书等法律文件进行了信息披露相关条款的修订。详情可见本基金管理人网站（[www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)）和中国证监会指定媒介刊登的法律文件及公告。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

中国证监会批准设立浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金的文件；

《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合同》；

《浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；

报告期内在指定媒介上披露的各项公告；

基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

基金管理人住所及托管人住所。

### 13.3 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](http://www.stocke.com.cn)。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二〇二〇年四月二十九日