

浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:中国银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 30 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(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	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53

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	53
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	浙商汇金转型驱动
基金主代码	001540
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年07月27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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	104,087,158.86份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于与经济转型相关的上市公司，通过精选个股和严格控制风险，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金通过定性分析和定量分析互补的研究手段，深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标和政策因素等，动态调整基金资产中股票和债券等类别资产的比例，有效的控制不同市场形势下的风险和收益水平。</p> <p>本基金主要投资于在中国经济结构转型的时代背景下，能够主动通过选择新的经济驱动模式，适应经济增速阶段性回落的新常态，展现自身优势并取得显著业绩增长的行业和上市公司。</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高预期收益和风险水平的投资品种，预期风险和收益水平低于股票型基金，但高于债券型基金和货币型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌	许俊
	联系电话	0571-87903297	010-66594319
	电子邮箱	fund@stocke.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95345	95566
传真		0571-87902581	010-66594942
注册地址		杭州市拱墅区天水巷25号	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼7楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		310020	100818
法定代表人		盛建龙	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.stocke.com.cn
基金中期报告备置地点	杭州市上城区五星路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	杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼7楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	32,267,663.14
本期利润	15,617,704.01
加权平均基金份额本期利润	0.1364
本期加权平均净值利润率	9.66%
本期基金份额净值增长率	9.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	46,713,176.95
期末可供分配基金份额利润	0.4488
期末基金资产净值	162,706,781.21
期末基金份额净值	1.563
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	56.30%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	4.97%	1.44%	0.79%	0.51%	4.18%	0.93%
过去三个月	21.82%	1.48%	6.30%	0.48%	15.52%	1.00%
过去六个月	9.15%	1.84%	5.00%	0.70%	4.15%	1.14%

过去一年	34.63%	1.78%	11.22%	0.87%	23.41%	0.91%
过去三年	119.52%	1.56%	24.18%	1.02%	95.34%	0.54%
自基金合同生效起至今	56.30%	1.43%	-9.00%	1.14%	65.30%	0.29%

注：本基金业绩比较基准：中证500指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

中证500指数由中证指数有限公司编制，全部A股中剔除沪深300指数成份股及总市值排名前300名的股票后，总市值排名靠前的500只股票组成，综合反映中国A股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够反映本基金的风险收益特征。本基金业绩基准指数每日按照70%、30%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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



§ 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2021年06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、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、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、浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）、浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚泓两年定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商汇金安享66个月定期开放债券型证券投资基金和浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金。

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		
周涛	总经理助理；本基金基金经理；浙商汇金转型成长混合型基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型基金及浙商汇金新兴消费灵活配置混合型基金的基金经理	2019-01-16	-	15年	中国国籍，硕士，曾任国金证券研究所首席行业分析师、齐鲁证券研究所所长、浙商证券证券投资部总经理、浙商资本副总经理。2017年加入浙江浙商证券资产管理有限公司，现任总经理助理、浙商汇

					金转型成长混合型基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型基金、浙商汇金新兴消费灵活配置混合型基金基金经理。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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金基金经理未存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

报告期内，本基金净值上涨9.15%，跑赢同期业绩比较基准及中证500等主要市场指数。

2021年上半年，影响国内资本市场运行的内外宏观因素分别为：美联储缩表的快慢；国内通胀压力的大小。从行业及公司层面看，驱动市场运行的内在动力则是优质赛道的持续高景气以及部分上市公司业绩的持续提升，特别是批量的顺周期行业的持续环比业绩大幅增长。以上因素交织在一起，共同构造了上半年震荡偏强的市场运行格局。在犹豫豫中，板块与个股的分化持续加大。1季度出现的抱团股的瓦解，在2季度出现了抱团股的再次分化，一批核心资产在2季度再次创出新高，这些股票主要集中在新能源，部分医药及消费类公司。如果我们从量化的角度分析的话，可以概括为市场交易的核心驱动因子是成长。从分类指数比较看，首先是成长风格的表现，其次才是大小盘风格的表现。

展望下半年，美国经济的复苏相比中国依然有比较优势，全球通胀压力犹存，且本轮经济周期的供给与需求双重驱动特征，表征未来通胀可能整体上台阶。国内出口大概率高位维持、制造业投资稳定增加、消费需求缓慢恢复依然是主旋律。在确定性的流动性收缩背景下，市场依然以结构性特征为主。

以上证综指PE估值测算，当前市场整体估值处于历史60%多分位数，并非全面偏高。且与历史上的类似经济运行阶段并没有很好的可比性。也就是说我们在未来的基金组合管理中，重点是既要挖掘结构性的成长机会，又要兼顾组合的估值高低与防御性，以相对均衡的配置，获取更具性价比的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商汇金转型驱动基金份额净值为1.563元，本报告期内，基金份额净值增长率为9.15%，同期业绩比较基准收益率为5.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年上半年已经过去，各类投资者对全球经济形势的关注点非常聚焦。其中美联储的Taper成为全球资本市场最为关注的焦点。下半年的重要时间节点为8月底的杰克逊霍尔全球央行会议，以及9月底的FOMC会议，美联储当前及未来将不断提供新的线索，为正式宣布讨论Taper做铺垫，市场预期正式开始实施Taper仍可能是今年年底或明年年初。

在此背景之下，由于中国经济与全球经济特别是美国经济的恢复速度并不一致，中国领先于全球复苏，故中国的货币政策提前收缩的预期也更提前。同时我们也看到国内经济的局部韧性表现。综合考虑国际错位与理性应对，预计下半年国内货币政策依然以中性为主，不会过紧也不会过松。

而反观证券市场的表现，经济的持续向好与流动性必然收缩的预期，导致今年的证券市场表现十分特别，1季度的核心资产如“茅”指数的表现，2季度“宁”指数的表现，以及贯穿整个市场的顺周期及中小市值公司的困境反转或者价值重估。反映出市场参与者的焦虑心态，同时也表征出市场参与者的不同风格特性。

预计下半年依然会延续这种结构性的行情特性。每年资本市场运行过程中逃不开的永恒话题是风格转换，今年由于极致的股票表现，大家尤为担忧。我们认为，在各自的能力圈范围内，聚焦相对更加优秀的行业，或者寻找符合自身投资模式的优势个股。以组合的方式去寻求稳健收益可能是其中一个不错的选择。

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 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运行情况，本基金在本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,121,293.26	16,607,522.22
结算备付金		0.41	5,037,354.12
存出保证金		33,321.88	19,008.55
交易性金融资产	6.4.7.2	149,845,972.77	182,176,810.50
其中：股票投资		149,845,972.77	182,176,810.50
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	3,190,375.76
应收利息	6.4.7.5	1,572.41	1,333.79
应收股利		-	-
应收申购款		153,058.63	62,412.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		164,155,219.36	207,094,817.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,824,719.93
应付赎回款		861,962.58	5,771,277.48
应付管理人报酬		193,306.94	254,333.31
应付托管费		32,217.85	42,388.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	278,302.60	421,737.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,648.18	170,705.91
负债合计		1,448,438.15	8,485,162.73
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	104,087,158.86	138,730,660.56

未分配利润	6.4.7.10	58,619,622.35	59,878,994.39
所有者权益合计		162,706,781.21	198,609,654.95
负债和所有者权益总计		164,155,219.36	207,094,817.68

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.563元，基金份额总额104,087,158.86份。

6.2 利润表

会计主体：浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		17,379,937.46	85,366,296.36
1. 利息收入		26,381.49	99,432.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,334.12	92,184.13
债券利息收入		47.37	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	7,248.18
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		33,907,763.91	61,573,286.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	33,507,370.96	61,085,925.06
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	116,689.10	-
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	283,703.85	487,361.02
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-16,649,959.13	23,577,369.86
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	95,751.19	116,208.11
减：二、费用		1,762,233.45	2,630,866.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,211,612.13	1,840,979.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	201,935.37	306,829.94
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	265,451.45	398,217.07
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.18	26.09
7. 其他费用	6.4.7.21	83,234.32	84,813.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,617,704.01	82,735,429.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,617,704.01	82,735,429.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021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)	138,730,660.56	59,878,994.39	198,609,654.95
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	15,617,704.01	15,617,704.01
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)	-34,643,501.70	-16,877,076.05	-51,520,577.75
其中: 1. 基金申购款	18,891,382.14	7,638,222.21	26,529,604.35
2. 基金赎回 款	-53,534,883.84	-24,515,298.26	-78,050,182.10
四、本期向基金份额 持有人分配利润产 生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	104,087,158.86	58,619,622.35	162,706,781.21
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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)	305,075,678.25	-49,410,773.05	255,664,905.20
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	82,735,429.74	82,735,429.74
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)	-109,320,070.32	-1,845,503.59	-111,165,573.91
其中: 1. 基金申购款	35,403,929.64	673,584.19	36,077,513.83

2. 基金赎回款	-144,723,999.96	-2,519,087.78	-147,243,087.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	195,755,607.93	31,479,153.10	227,234,761.03

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

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)(证监许可[2015]1244号)《关于准予浙商汇金转型驱动灵活配置混合型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《浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》向社会公开发行募集。《浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年7月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,481,882,806.40份基金份额,相关募集业经北京兴华会计师事务所[2015]京会兴浙分验字第68000083号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式基金,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

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)并参照《证券投资基金会计核算业务指引》及《浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定而编制的。

本财务报表以持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年06月30日的财务状况以及2021年中期的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

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 2021年06月30日
活期存款	14,121,293.26
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	14,121,293.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		85,394,150.19	149,845,972.77	64,451,822.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		85,394,150.19	149,845,972.77	64,451,822.58

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末，未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末，未持有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 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,557.41
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	15.00
合计	1,572.41

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末，未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	278,302.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	278,302.60

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,065.17
应付证券出借违约金	-
预提费用	80,583.01
合计	82,648.18

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	138,730,660.56	138,730,660.56
本期申购	18,891,382.14	18,891,382.14
本期赎回（以“-”号填列）	-53,534,883.84	-53,534,883.84
本期末	104,087,158.86	104,087,158.86

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

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
上年度末	25,842,354.94	34,036,639.45	59,878,994.39
本期利润	32,267,663.14	-16,649,959.13	15,617,704.01
本期基金份额交易产生的变动数	-11,396,841.13	-5,480,234.92	-16,877,076.05
其中：基金申购款	6,768,699.16	869,523.05	7,638,222.21
基金赎回款	-18,165,540.29	-6,349,757.97	-24,515,298.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,713,176.95	11,906,445.40	58,619,622.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	活期存款利息收入	25,354.08
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	787.03	
其他	193.01	

合计	26,334.12
----	-----------

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	108,423,579.08
减：卖出股票成本总额	74,916,208.12
买卖股票差价收入	33,507,370.96

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
	2021年01月01日至2021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	116,689.10
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	116,689.10

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
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	476,738.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期	360,000.00

兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	48.92
买卖债券差价收入	116,689.10

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未进行资产支持证券投资。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期未进行贵金属投资。

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

本基金本报告期未进行权证投资。

6.4.7.16.2 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。

6.4.7.17 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	283,703.85
其中: 证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	283,703.85

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-16,649,959.13
——股票投资	-16,649,959.13
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——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	-16,649,959.13

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	95,751.19
合计	95,751.19

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	265,451.45
银行间市场交易费用	-
合计	265,451.45

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	21,075.64
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
汇划手续费	2,651.31
合计	83,234.32

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。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

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
中国银行股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构

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。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例

浙商证券股份有限公司	86,541,536.20	52.54%	84,779,673.79	38.71%
------------	---------------	--------	---------------	--------

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行债券交易。

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
浙商证券股份有限公司	-	-	74,300,000.00	100.00%

注：本基金在本报告期内，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
浙商股份有限	80,596.57	59.02%	490.18	0.18%

公司				
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
浙商证券股份有限公司	78,955.61	44.58%	16,219.05	1.18%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,211,612.13	1,840,979.79
其中：支付销售机构的客户维护费	576,595.99	915,009.67

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	201,935.37	306,829.94

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

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

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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间内，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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间内，未发生与关联方通过约定申报方式进行的使用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期及上年度可比期间内，未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日

报告期初持有的基金份额	4,000,000.00	9,999,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	800,000.00	2,199,000.00
报告期末持有的基金份额	3,200,000.00	7,800,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.07%	3.98%

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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

在本报告期末及上年度末均未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	14,121,293.26	25,354.08	40,082,557.53	90,176.21

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688059	华锐精密	2021-02-01	2021-08-09	科创板打新限售	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
688317	之江生物	2021-01-08	2021-07-19	科创板打新限售	43.22	63.82	1,640	70,880.80	104,664.80	-
688316	青云科技	2021-03-05	2021-09-16	科创板打新限售	63.70	65.00	635	40,449.50	41,275.00	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,637	41,083.82	41,083.82	-
301021	C英诺	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.44	24,681.44	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	创业板打新限售	7.64	38.83	411	3,140.04	15,959.13	-
300941	创识科技	2021-02-	2021-08-	创业板打	21.31	49.94	280	5,966.80	13,983.2	-

		02	09	新限售					0	
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	115.71	120	3,393.60	13,885.20	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	创业板打新限售	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	创业板打新限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	24.69	31.71	345	8,518.05	10,939.95	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	创业板打新限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	创业板打新限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
3009	通用	2021	2021	创业	4.31	13.1	672	2,89	8,80	-

31	电梯	-01- 13	-07- 21	板打 新限 售		1		6.32	9.92	
3009 61	深水 海纳	2021 -03- 23	2021 -09- 30	创业 板打 新限 售	8.48	22.0 7	394	3,34 1.12	8,69 5.58	-
3009 50	德固 特	2021 -02- 24	2021 -09- 03	创业 板打 新限 售	8.41	39.1 3	219	1,84 1.79	8,56 9.47	-
3009 26	博俊 科技	2020 -12- 29	2021 -07- 07	创业 板打 新限 售	10.7 6	22.2 0	359	3,86 2.84	7,96 9.80	-
3009 30	屹通 新材	2021 -01- 13	2021 -07- 21	创业 板打 新限 售	13.1 1	24.4 8	322	4,22 1.42	7,88 2.56	-
3009 52	恒辉 安防	2021 -03- 03	2021 -09- 13	创业 板打 新限 售	11.7 2	27.0 8	284	3,32 8.48	7,69 0.72	-
3009 56	英力 股份	2021 -03- 16	2021 -09- 27	创业 板打 新限 售	12.8 5	25.8 0	297	3,81 6.45	7,66 2.60	-
3009 93	玉马 遮阳	2021 -05- 17	2021 -11- 24	创业 板打 新限 售	12.1 0	19.2 9	373	4,51 3.30	7,19 5.17	-
3009 78	东箭 科技	2021 -04- 15	2021 -10- 26	创业 板打 新限	8.42	13.6 0	519	4,36 9.98	7,05 8.40	-

				售						
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	创业板打新限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	创业板打新限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	创业板打新限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	创业板打新限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	创业板打新限售	12.13	22.49	255	3,093.15	5,734.95	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	创业板打新限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
3010	漱玉	2021	-	创业	8.86	8.86	516	4,57	4,57	-

17	平民	-06-23		板打新限售				1.76	1.76	
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	创业板打新限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	创业板打新限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	创业板打新限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301021	C英诺	2021-06-28	-	创业板打新限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	-	56.35	-	-	120,000	3,547,232.00	6,762,000.00	-

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2021年6月30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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2020年6月30日止，本基金未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

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。

公司目前的组织架构体系主要有五个层次：一是董事会及专门委员会的风险管理战略性安排，以及监事的监督检查；二是经理层、经理层下设业务委员会的风险管理决策；三是风险管理部门的风控制衡；四是业务部门及业务立项委员会、产品设计委员会的直接管理；五是合规风控专员在业务部门内部的风控制衡。各风险管理层级按照公司《全面风险管理办法》要求在各自职责范围内履行风险管理职责。业务部门、风险管理部门、审计稽核部门共同构成了风险管理三道防线，实施事前、事中与事后的风险防范、监控与评价工作。

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中国银行，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

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

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 2021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	14,121, 293.26	-	-	-	-	14,121,293.26
结算备付金	0.41	-	-	-	-	0.41

存出保证金	33,321.88	-	-	-	-	33,321.88
交易性金融资产	149,845,972.77	-	-	-	-	149,845,972.77
资产总计	164,000,588.32	-	-	-	-	164,000,588.32
负债	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	164,000,588.32	-	-	-	-	164,000,588.32
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	-
银行存款	16,607,522.22	-	-	-	-	16,607,522.22
结算备付金	5,037,354.12	-	-	-	-	5,037,354.12
存出保证金	19,008.55	-	-	-	-	19,008.55
交易性金融资产	182,176,810.50	-	-	-	-	182,176,810.50
资产总计	203,840,695.39	-	-	-	-	203,840,695.39
负债	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	203,840,695.39	-	-	-	-	203,840,695.39

	9					
--	---	--	--	--	--	--

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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。

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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	14,121,293.26	-	-	-	-	-	14,121,293.26
结算备付金	0.41	-	-	-	-	-	0.41
存出保证金	33,321.88	-	-	-	-	-	33,321.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	149,845,972.77	149,845,972.77
应收利息	-	-	-	-	-	1,572.41	1,572.41
应收申购款	-	-	-	-	-	153,058.63	153,058.63

浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

资产总计	14,154,615.55	-	-	-	-	150,000,603.81	164,155,219.36
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	861,962.58	861,962.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	193,306.94	193,306.94
应付托管费	-	-	-	-	-	32,217.85	32,217.85
应付交易费用	-	-	-	-	-	278,302.60	278,302.60
其他负债	-	-	-	-	-	82,648.18	82,648.18
负债总计	-	-	-	-	-	1,448,438.15	1,448,438.15
利率敏感度缺口	14,154,615.55	-	-	-	-	148,552,165.66	162,706,781.21
上年度末 2020年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	16,607,522.22	-	-	-	-	-	16,607,522.22
结算备付金	5,037,354.12	-	-	-	-	-	5,037,354.12
存出保证金	19,008.55	-	-	-	-	-	19,008.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	182,176,810.50	182,176,810.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,190,375.76	3,190,375.76
应收利息	-	-	-	-	-	1,333.79	1,333.79
应收申购款	-	-	-	-	-	62,412.74	62,412.74
资产总计	21,663,884.89	-	-	-	-	185,430,932.79	207,094,817.68
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,824,719.93	1,824,719.93
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,771,277.48	5,771,277.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	254,333.31	254,333.31

应付托管费	-	-	-	-	-	42,388.89	42,388.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	421,737.21	421,737.21
其他负债	-	-	-	-	-	170,705.91	170,705.91
负债总计	-	-	-	-	-	8,485,162.73	8,485,162.73
利率敏感度缺口	21,663,884.89	-	-	-	-	176,945,770.06	198,609,654.95

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

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，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	149,845,972.77	92.10	182,176,810.50	91.73
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	149,845,972.77	92.10	182,176,810.50	91.73

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深300指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3、Beta系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去100个交易日与其对应的指数数据回归加权得出。		
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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1、沪深300指数上涨5%	9,796,857.02	10,674,424.33
	2、沪深300指数下跌5%	-9,796,857.02	-10,674,424.33

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180天		
分析	风险价值	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日

	风险价值	-5,491,215.23	-4,602,422.78
	合计	-5,491,215.23	-4,602,422.78

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	149,845,972.77	91.28
	其中：股票	149,845,972.77	91.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,121,293.67	8.60
8	其他各项资产	187,952.92	0.11
9	合计	164,155,219.36	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,749.88	0.00

B	采矿业	-	-
C	制造业	99,249,734.47	61.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	4,401,417.67	2.71
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,229,180.78	14.89
J	金融业	7,829,201.40	4.81
K	房地产业	10,787.40	0.01
L	租赁和商务服务业	4,471,632.00	2.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	24,582.73	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,607,010.00	5.90
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	149,845,972.77	92.10

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	29,400	15,723,120.00	9.66
2	600438	通威股份	246,900	10,683,363.00	6.57
3	300760	迈瑞医疗	21,100	10,129,055.00	6.23

4	300347	泰格医药	49,700	9,607,010.00	5.90
5	300059	东方财富	235,800	7,731,882.00	4.75
6	000661	长春高新	17,700	6,849,900.00	4.21
7	600460	士兰微	120,000	6,762,000.00	4.16
8	300014	亿纬锂能	63,697	6,620,029.21	4.07
9	300496	中科创达	41,552	6,526,157.12	4.01
10	600570	恒生电子	67,360	6,281,320.00	3.86
11	002920	德赛西威	53,300	5,867,264.00	3.61
12	603501	韦尔股份	18,200	5,860,400.00	3.60
13	002415	海康威视	82,300	5,308,350.00	3.26
14	688111	金山办公	11,975	4,727,730.00	2.91
15	600315	上海家化	76,900	4,624,766.00	2.84
16	002027	分众传媒	475,200	4,471,632.00	2.75
17	600660	福耀玻璃	75,900	4,239,015.00	2.61
18	603290	斯达半导	13,000	4,160,000.00	2.56
19	600827	百联股份	199,500	4,019,925.00	2.47
20	300450	先导智能	66,560	4,002,918.40	2.46
21	300454	深信服	13,800	3,580,824.00	2.20
22	300782	卓胜微	5,400	2,902,500.00	1.78
23	688561	奇安信	30,596	2,824,316.76	1.74
24	600690	海尔智家	105,000	2,720,550.00	1.67
25	300999	金龙鱼	4,099	348,251.04	0.21
26	300919	中伟股份	2,132	347,516.00	0.21
27	300866	安克创新	2,039	341,471.33	0.21
28	688135	利扬芯片	5,658	318,998.04	0.20
29	688063	派能科技	1,288	253,478.40	0.16
30	301015	百洋医药	4,101	223,189.53	0.14
31	688083	中望软件	399	220,367.70	0.14
32	300973	立高食品	1,197	180,820.20	0.11
33	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.10
34	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.10

35	300937	药易购	1,934	106,089.04	0.07
36	688317	之江生物	1,640	104,664.80	0.06
37	300922	天秦装备	2,863	99,718.29	0.06
38	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.04
39	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.04
40	301017	漱玉平民	5,153	45,655.58	0.03
41	688316	青云科技	635	41,275.00	0.03
42	300753	爱朋医疗	1,646	37,232.52	0.02
43	300894	火星人	523	35,564.00	0.02
44	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
45	300910	瑞丰新材	300	31,365.00	0.02
46	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.02
47	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
48	300913	兆龙互连	700	18,340.00	0.01
49	300940	南极光	368	16,038.26	0.01
50	300941	创识科技	299	14,959.80	0.01
51	300909	汇创达	338	14,567.80	0.01
52	300932	三友联众	442	14,058.50	0.01
53	300907	康平科技	473	13,915.66	0.01
54	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
55	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
56	300933	中辰股份	1,117	11,662.18	0.01
57	300918	南山智尚	1,100	11,451.00	0.01
58	300950	德固特	286	11,320.49	0.01
59	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
60	300917	特发服务	390	10,787.40	0.01
61	300908	仲景食品	179	10,666.61	0.01
62	300930	屹通新材	420	10,321.78	0.01
63	300962	中金辐照	600	10,005.12	0.01
64	300867	圣元环保	324	9,820.44	0.01
65	300966	共同药业	300	9,660.38	0.01

66	300956	英力股份	365	9,506.76	0.01
67	301011	华立科技	250	9,424.50	0.01
68	300931	通用电梯	700	9,185.68	0.01
69	300952	恒辉安防	331	9,014.24	0.01
70	300961	深水海纳	400	8,842.94	0.01
71	300926	博俊科技	384	8,534.80	0.01
72	300993	玉马遮阳	425	8,492.57	0.01
73	300978	东箭科技	589	8,338.70	0.01
74	300927	江天化学	263	7,928.72	0.00
75	300943	春晖智控	342	7,925.10	0.00
76	300963	中洲特材	300	7,129.95	0.00
77	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
78	300967	晓鸣股份	561	6,749.88	0.00
79	300975	商络电子	500	6,558.52	0.00
80	300929	华骐环保	200	5,919.35	0.00
81	301012	扬电科技	191	4,854.16	0.00
82	301007	德迈仕	322	4,766.15	0.00
83	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600827	百联股份	7,152,025.98	3.60
2	002920	德赛西威	5,632,756.00	2.84
3	002027	分众传媒	5,471,387.00	2.75
4	300496	中科创达	5,434,600.02	2.74
5	603501	韦尔股份	5,303,911.00	2.67
6	300450	先导智能	4,012,696.00	2.02
7	600660	福耀玻璃	3,862,655.00	1.94

8	600690	海尔智家	3,646,519.00	1.84
9	600460	士兰微	3,547,232.00	1.79
10	603290	斯达半导	3,422,592.00	1.72
11	688561	奇安信	3,420,671.82	1.72
12	300782	卓胜微	1,927,653.00	0.97
13	600570	恒生电子	1,818,780.00	0.92
14	300454	深信服	1,624,306.00	0.82
15	688819	天能股份	118,600.02	0.06
16	300932	三友联众	84,982.98	0.04
17	688317	之江生物	70,880.80	0.04
18	688680	海优新材	70,849.22	0.04
19	688687	凯因科技	65,329.16	0.03
20	688083	中望软件	60,049.50	0.03

注：1、表中买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、表中“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300014	亿纬锂能	9,070,405.00	4.57
2	600588	用友网络	6,350,436.07	3.20
3	600276	恒瑞医药	6,264,138.00	3.15
4	300750	宁德时代	6,104,275.00	3.07
5	002475	立讯精密	5,975,277.25	3.01
6	002050	三花智控	5,451,797.60	2.74
7	600703	三安光电	4,473,886.00	2.25
8	600745	闻泰科技	4,462,585.00	2.25
9	600887	伊利股份	4,163,111.00	2.10
10	600438	通威股份	4,037,943.00	2.03

11	000066	中国长城	3,922,657.00	1.98
12	600584	长电科技	3,662,509.63	1.84
13	603939	益丰药房	3,572,564.00	1.80
14	002600	领益智造	3,107,302.00	1.56
15	600827	百联股份	2,993,443.00	1.51
16	688126	沪硅产业	2,946,346.39	1.48
17	002008	大族激光	2,905,684.97	1.46
18	300348	长亮科技	2,691,369.00	1.36
19	300136	信维通信	2,468,125.00	1.24
20	002624	完美世界	2,387,202.50	1.20

注：1、表中卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、表中“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	59,235,329.52
卖出股票收入（成交）总额	108,423,579.08

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期收到调查以及处罚的情况的说明 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	33,321.88

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,572.41
5	应收申购款	153,058.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	187,952.92

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	6,762,000.00	4.16	停牌

7.12.6 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。

§ 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

2,119	49,120.89	5,839,834.83	5.610%	98,247,324.03	94.390%
-------	-----------	--------------	--------	---------------	---------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	450,546.76	0.4251%

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本报告期末未持有本基金；
- 2、本基金的基金经理本报告期末未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年07月27日)基金份额总额	1,481,882,806.40
本报告期期初基金份额总额	138,730,660.56
本报告期基金总申购份额	18,891,382.14
减：本报告期基金总赎回份额	53,534,883.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	104,087,158.86

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。

§ 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，未召开基金份额持有人大会。

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

2021年6月18日，基金管理人增聘袁放先生、吴俊毅先生、胡长泉先生担任独立董事。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本报告期内为本基金进行审计的会计师事务所无变更。

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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	7,164,083.52	4.35%	5,239.31	3.84%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	59,458,355.92	36.10%	42,292.51	30.97%	-
兴业证券	1	11,537,388.26	7.01%	8,437.28	6.18%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	86,541,536.20	52.54%	80,596.57	59.02%	-

注：a)截至报告期末，本公司已在上海交易所、深圳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，本基金退租了国泰君安000488和中信建投000524两个交易单元。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	476,738.02	100.00%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-21
2	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下基金2020年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-01-21
3	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与上海天天基金销售有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-08
4	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与上海中正达广基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-22
5	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与民生证券股份有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-27
6	浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-30
7	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下基金2020年年度报	中国证监会规定媒介	2021-03-30

	告提示性公告		
8	浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
9	浙江浙商证券资产管理有限公司旗下基金2021年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
10	浙江浙商证券资产管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021-06-19

§ 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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内未出现其他影响投资者决策的重要信息。

§ 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转型驱动灵活配置混合型证券投资基金的文件；
《浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
《浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
报告期内在规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。

12.2 存放地点

基金管理人住所及托管人住所。

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
二〇二一年八月三十日