浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2026年第3季度报告

2026年09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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27日

§1 重要提示

浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浙商鼎盈事件驱动混合（LOF)
场内简称	浙商鼎盈（LOF)
基金主代码	169201
基金运作方式	契约型、上市开放式
基金合同生效日	2016年12月07日
报告期末基金份额总额	6,164,118.84份
投资目标	在封闭期内，本基金主要投资于定向增发的证券，基金管理人在严格控制风险的前提下，通过对定向增发证券投资价值的深入分析，力争基金资产的长期稳定增值。转为上市开放式基金（LOF）后，本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的基础上，挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下的事件性投资机会，力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	（一）在本基金封闭期内，本基金通过对宏观经济、中观行业分析与定向增发项目优势的深入研究，优选具有较高折价保护并且通过定向增发能够改善、提升企业基本面与经营状况的

	定向增发股票进行投资，形成以定向增发为核心的投资策略，力求基金资产的长期稳健增值。1、资产配置策略；2、定向增发策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、权证投资策略；8、中小企业私募债券投资策略。（二）本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，本基金将在宏观经济、中观行业分析的基础上，积极寻找事件驱动下的股票二级市场投资机会，形成以事件驱动为核心的投资策略，力求基金资产的长期稳健增值。1、资产配置策略；2、事件驱动股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、权证投资策略；8、中小企业私募债券投资策略。
业绩比较基准	沪深300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，一般市场情况下，长期风险收益特征高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026年07月01日 - 2026年09月30日）
1.本期已实现收益	-2,964,940.41
2.本期利润	-5,497,461.39
3.加权平均基金份额本期利润	-1.1388
4.期末基金资产净值	10,345,535.93
5.期末基金份额净值	1.6783

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本期利息收入、投资收益、其他收入（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

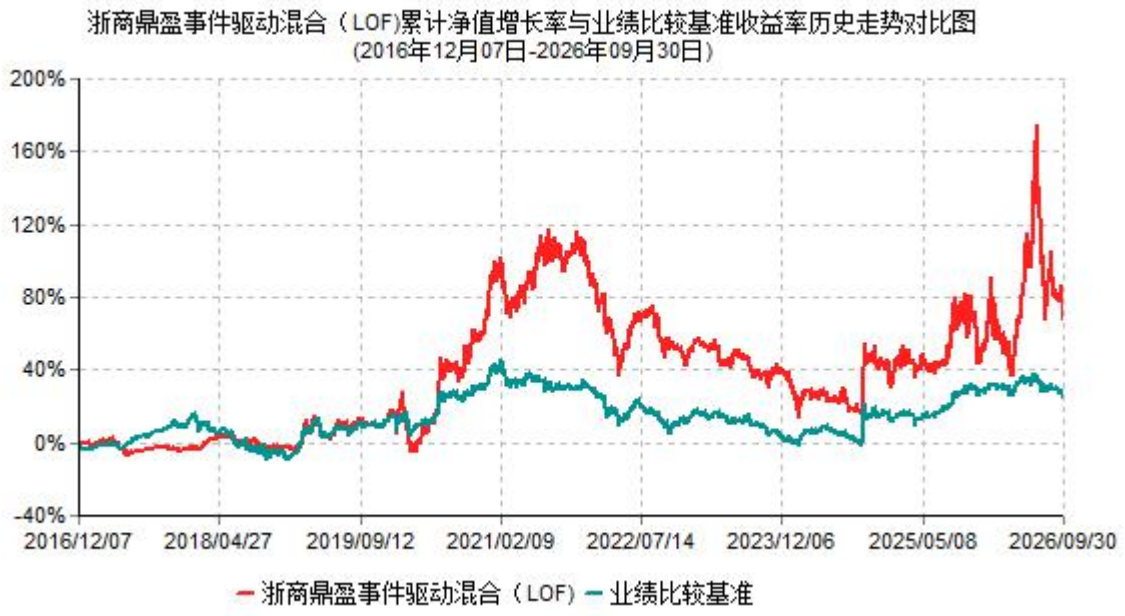
3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-38.98%	2.84%	-8.70%	0.90%	-30.28%	1.94%
过去六个月	22.23%	3.05%	-0.98%	0.90%	23.21%	2.15%
过去一年	-6.39%	2.93%	-3.74%	0.79%	-2.65%	2.14%
过去三年	21.88%	2.12%	15.18%	0.80%	6.70%	1.32%
过去五年	-15.64%	1.79%	-4.00%	0.78%	-11.64%	1.01%
过去七年	53.42%	1.76%	15.65%	0.82%	37.77%	0.94%
自基金合同生效起至今	67.83%	1.53%	25.13%	0.81%	42.70%	0.72%

注：本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张雷	本基金基金经理	2025-03-14	-	10年	中国国籍，硕士，曾任中国中投证券有限责任公司研究总部电子行业研究员、国泰君安证券股份有限公司研究所电子行业研究员、新华基金管理股份有限公司研究部TMT研究员、鹏华基金管理股份有限公司基金经理助理；现任浙江浙商证券资产管理有限公司浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型基金(LOF)的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。

注：1、上述表格内基金经理的任职日期、离职日期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。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.1.1 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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、其他相关法律法规和本基金合同的约定，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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026年三季度A股三大指数均大幅下跌，沪深300指数跌幅约为12.5%，创业板跌幅为27.8%，科创板跌幅为30.7%，上半年具备超额收益的科技行业在三季度跌幅尤其突出。

本基金三季度持仓主要分布在电子、传媒、医药生物、计算机等科技行业，因此在三季度出现较大回撤。三季度科技板块整体回撤的原因是多方面的，其中海外利率和国际局势等宏观环境的影响是最重要的因素之一。本基金继续坚持围绕科技方向运作，因为从中长期来看，我们认为AI仍然是新一轮康波周期上行的驱动力，人工智能的新技术和产业升级仍然是最核心的投资方向。展望四季度至明年，科技成长仍可能是配置主线。

本基金在三季度自上而下继续将具备较高行业景气度且业绩较优的科技板块作为基金配置主线，同时把握中美战略竞争带来的国内科技产业链自主可控的投资机遇；自下而上立足于重大事件对上市公司估值重构、治理结构变化、盈利提升的影响，精选能够充分受益产业发展红利或者基本面有边际变化的标的。

本基金在三季度基于人工智能在生物医药领域应用的快速发展，适当增加了生物医药行业的配置，降低了组合在TMT行业的集中度，同时降低了组合的整体估值水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商鼎盈事件驱动混合（LOF)基金份额净值为1.6783元，本报告期内，基金份额净值增长率为-38.98%，同期业绩比较基准收益率为-8.70%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金于2026年07月01日至2026年09月30日持续出现基金资产净值低于5000万的情形。公司已向中国证监会报告并推进相关应对方案。同时，为切实保障基金份额持有人利益，自2024年7月1日起，我司承担迷你基金的固定费用，直至产品改变迷你基金状态为止。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	8,588,541.00	70.44
	其中：股票	8,588,541.00	70.44
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	3,330,732.34	27.32
8	其他资产	273,568.12	2.24
9	合计	12,192,841.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,998,290.00	57.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,049,667.00	10.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,540,584.00	14.89
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,588,541.00	83.02

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	700	706,307.00	6.83

2	688072	拓荆科技	1,000	640,000.00	6.19
3	002371	北方华创	1,000	615,970.00	5.95
4	688012	中微公司	1,600	509,680.00	4.93
5	688120	华海清科	2,000	454,860.00	4.40
6	688041	海光信息	2,000	453,600.00	4.38
7	600584	长电科技	6,000	385,680.00	3.73
8	688652	京仪装备	2,800	365,904.00	3.54
9	688147	微导纳米	3,600	365,076.00	3.53
10	603986	兆易创新	1,000	353,900.00	3.42

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,363.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	251,204.51
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	273,568.12

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	5,003,101.08
报告期期间基金总申购份额	2,747,822.35

减：报告期期间基金总赎回份额	1,586,804.59
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	6,164,118.84

注：总申购份额含红利再投、转入份额，总赎回份额含转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未发生固有资金申购、赎回本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人聘任楼小平先生为总经理、董事长，盛建龙先生不再担任总经理、董事长。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准设立浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金的文件；

《浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》；

《浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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。

9.2 存放地点

基金管理人住所、托管人住所及深圳证券交易所。

9.3 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

2026年10月27日