

浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金  
(LOF)

2025 年年度报告

2025 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 03 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年3月30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。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金财务会计报告出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2025年01月01日起至2025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	6
2.4	信息披露方式	6
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	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6	审计报告	16
6.1	审计报告基本信息	16
6.2	审计报告的基本内容	16
§ 7	年度财务报表	20
7.1	资产负债表	20
7.2	利润表	22
7.3	净资产变动表	23
7.4	报表附注	25
§ 8	投资组合报告	53
8.1	期末基金资产组合情况	53
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	54
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	84
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	84
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	84
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	85
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	85
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	85

8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	85
8.12	投资组合报告附注	85
§ 9	基金份额持有人信息	86
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	86
9.2	期末上市基金前十名持有人	86
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	87
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	87
§ 10	开放式基金份额变动	87
§ 11	重大事件揭示	87
11.1	基金份额持有人大会决议	87
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	88
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	88
11.4	基金投资策略的改变	88
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	88
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	88
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	89
11.8	其他重大事件	91
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	92
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	92
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	93
§ 13	备查文件目录	93
13.1	备查文件目录	93
13.2	存放地点	93
13.3	查阅方式	93

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
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
报告期末基金份额总额	5,420,151.67份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年03月16日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
投资策略	<p>(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、</p>

	<p>权证投资策略；8、中小企业私募债券投资策略。</p> <p>(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。</p>
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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨锴
	联系电话	0571-87903297
	电子邮箱	fund@stocke.com.cn
客户服务电话	95345	95588
传真	0571-87902581	(010) 66105798
注册地址	浙江省杭州市拱墅区天水巷25号	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	浙江省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55号
邮政编码	310020	100140
法定代表人	盛建龙	廖林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露	上海证券报
------------	-------

露报纸名称	
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	浙江省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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §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	2025年	2024年	2023年
本期已实现收益	1,983,062.76	-73,856.82	-822,812.05
本期利润	1,939,161.04	-90,563.88	-406,583.90
加权平均基金份额本期利润	0.3041	-0.0120	-0.0438
本期加权平均净值利润率	20.18%	-0.92%	-3.00%
本期基金份额净值增长率	18.37%	0.14%	-4.63%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	2024年末	2023年末
期末可供分配利润	3,557,402.37	2,786,539.30	3,261,829.01
期末可供分配基金份额利润	0.6563	0.3993	0.3974

期末基金资产净值	8,977,554.04	9,765,010.40	11,470,328.99
期末基金份额净值	1.6563	1.3993	1.3974
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2025年末	2024年末	2023年末
基金份额累计净值增长率	65.63%	39.93%	39.74%

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

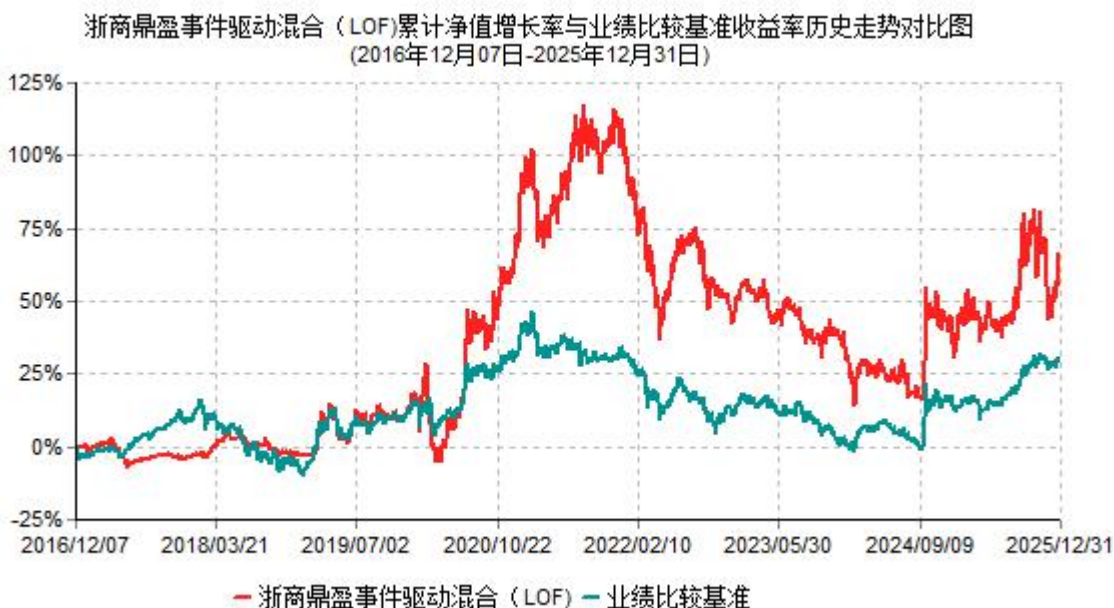
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去三个月	-7.62%	2.39%	-0.15%	0.66%	-7.47%	1.73%
过去六个月	14.38%	2.26%	11.60%	0.63%	2.78%	1.63%
过去一年	18.37%	1.98%	11.56%	0.66%	6.81%	1.32%
过去三年	13.03%	1.52%	15.99%	0.74%	-2.96%	0.78%
过去五年	-6.51%	1.47%	-4.36%	0.79%	-2.15%	0.68%
自基金合同生效起至今	65.63%	1.32%	29.80%	0.81%	35.83%	0.51%

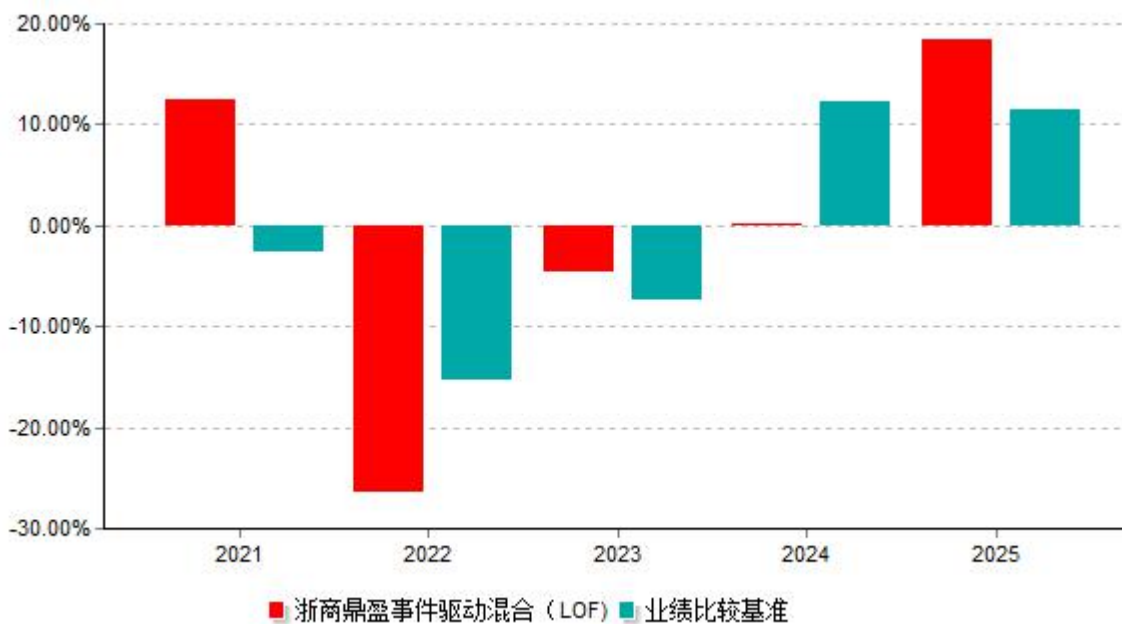
注：本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率\*70%+中国债券总指数收益率\*30%。  
 沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。  
 中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回

报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。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变动的比较



### 3.2.3 过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年，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，无利润分配。

## §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2025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（LOF）、浙商汇金短债债券型证券投资基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金聚盈中短债债券型证券投资基金、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、浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金、浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金、浙商汇金先进制造混合型证券投资基金、浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)、浙商汇金月享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浙商汇金兴利增强债券型证券投资基金、浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浙商汇金金算盘货币市场基金、浙商汇金聚瑞债券型证券投资基金、浙商汇金平稳增长一年持有期混合型证券投资基金、浙商汇金聚兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商汇金卓越稳健3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、浙商汇金中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、浙商汇金中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、浙商汇金聚悦利率债债券型证券投资基金、浙商汇金红利精选混合型发起式证券投资基金、浙商汇金红利

机遇混合型证券投资基金、浙商汇金聚津30天持有期高等级债券型证券投资基金、浙商汇金中证A500指数型证券投资基金、浙商汇金锦利增强30天持有期债券型证券投资基金和浙商汇金上证科创板综合指数型证券投资基金等36只基金。

#### 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		
马斌博	浙商汇金转型成长混合型证券投资基金的基金经理	2018-04-19	2025-03-14	13年	中国国籍，硕士，曾任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司研究员；浙江浙商证券资产管理有限公司研究部研究员、公募基金部基金经理助理、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金联接基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型基金、浙商汇金兴利增强债券型基金、浙商汇金先进制造混合型基金、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；现任浙商汇金转型成长混合型基金的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
张雷	本基金基金经理	2025-03-14	-	9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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

#### 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，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

2025年，上证指数、沪深300和创业板指分别累计上涨18.41%、17.66%和49.57%，全年各季内行业轮动较为明显，市场活跃度整体处于较高水平。我们在2024年年度报告中提到科技创新和产业升级是在总量经济进入稳态增长后的首要任务，认为这种趋势将延续全年。从2025年产业发展和资本市场的投资机会来看，上述产业趋势已经以超出预期的方式发展，全面智能化时代已经来临。

本产品在2025年全年的投资运作中，深度思考全球和国内重大事件背后的深层次产业变革、以及对各行业基本面的影响，继续围绕全球和国内科技升级的方向展开标的的挖掘和配置，主要涉及的行业方向包括电子、通信、计算机、机械、军工等行业，细分方向上进一步减少了低估值传统行业的投资，增加了科技成长行业的比重。

#### 4.4.2 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1.6563元,本报告期内,基金份额净值增长率为18.37%,同期业绩比较基准收益率为11.56%。

#### 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2026年,预计全球经济温和增长,发达经济体增速放缓但美国仍然领衔,通胀回落、央行逐步宽松,AI投资与新兴市场是全球经济引擎。展望2026年,预计国内经济温和修复但结构分化,出口继续保持韧性,消费温和复苏,政策财政和货币双宽松,降准降息可期,国内核心主线预计仍然为AI、新质生产力和高端制造。本基金在未来投资运作中,自上而下继续聚焦科技能力圈,沿着科技创新和新兴产业升级的方向,在科技创新和传统产业的智能化升级方向上继续深耕;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,精选符合产业发展趋势且基本面有边际变化的标的,为投资者持续创造超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,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

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。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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。

#### 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《浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定，在封闭期内，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数不得少于1次，年度收益分配比例不得低于基金年度可供分配利润的90%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。转换为上市开放式基金（LOF）后，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。本基金封闭期内的收益分配方式为现金分红。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，基金份额持有人选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式。具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；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基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；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资产承担。

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。

#### 4.9 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，本基金于2025年01月01日至2025年12月31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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--浙江浙商证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对浙江浙商证券资产管理有限公司编制和披露的本基金2025年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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	毕马威华振审字第2603084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	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人

<p>审计意见</p>	<p>我们审计了后附的浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“该基金”)财务报表,包括2025年12月31日的资产负债表,2025年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“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。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第1号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。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>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>该基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2025年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p>

	<p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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>

出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 评价该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。

(4) 对该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，就可能致对该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该基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

	我们与该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。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	倪益	谢晶菁
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2026-03-27	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	992,867.76	2,553,306.23
结算备付金		255,799.03	115,915.71
存出保证金		23,376.61	12,271.34
交易性金融资产	7.4.7.2	8,003,593.00	7,949,274.93
其中：股票投资		8,003,593.00	7,949,274.93
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		52,653.00	347.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		9,328,289.40	10,631,116.12
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<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		-	-
应付清算款		-	468,153.02
应付赎回款		104,041.49	-
应付管理人报酬		9,018.67	10,228.36
应付托管费		1,503.13	1,704.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	236,172.07	386,019.60
负债合计		350,735.36	866,105.72
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	5,420,151.67	6,978,471.10
未分配利润	7.4.7.8	3,557,402.37	2,786,539.30
净资产合计		8,977,554.04	9,765,010.40
负债和净资产总计		9,328,289.40	10,631,116.12

注：报告截止日2025年12月31日，基金份额净值1.6563元，基金份额总额5,420,151.67份。

## 7.2 利润表

会计主体：浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至2 025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2 024年12月31日
一、营业总收入		2,073,894.60	-69,364.58
1.利息收入		6,898.52	15,239.45
其中：存款利息收入	7.4.7.9	6,546.27	14,451.92
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		352.25	787.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		2,093,520.97	-71,208.64
其中：股票投资收益	7.4.7.10	2,069,313.53	-146,544.55
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	24,207.44	75,335.91
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.17	-43,901.72	-16,707.06
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号	7.4.7.18	17,376.83	3,311.67

填列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		134,733.56	21,199.30
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	115,253.33	117,804.65
2.托管费	7.4.10.2.2	19,208.96	19,634.15
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		1.27	2.84
8.其他费用	7.4.7.20	270.00	-116,242.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,939,161.04	-90,563.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,939,161.04	-90,563.88
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,939,161.04	-90,563.88

### 7.3 净资产变动表

会计主体：浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,978,471.10	2,786,539.30	9,765,010.40
二、本期期初净资产	6,978,471.10	2,786,539.30	9,765,010.40

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,558,319.43	770,863.07	-787,456.36
（一）、综合收益总额	-	1,939,161.04	1,939,161.04
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,558,319.43	-1,168,297.97	-2,726,617.40
其中：1.基金申购款	2,262,934.73	1,232,745.35	3,495,680.08
2.基金赎回款	-3,821,254.16	-2,401,043.32	-6,222,297.48
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	5,420,151.67	3,557,402.37	8,977,554.04
项目	上年度可比期间		
	2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,208,499.98	3,261,829.01	11,470,328.99
二、本期期初净资产	8,208,499.98	3,261,829.01	11,470,328.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,230,028.88	-475,289.71	-1,705,318.59
（一）、综合收益总额	-	-90,563.88	-90,563.88
（二）、本期基金	-1,230,028.88	-384,725.83	-1,614,754.71

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	371,200.56	121,777.56	492,978.12
2.基金赎回款	-1,601,229.44	-506,503.39	-2,107,732.83
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	6,978,471.10	2,786,539.30	9,765,010.40

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

徐海锋

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

浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(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[2016]1634号）《关于准予浙商汇金鼎盈定增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《浙商汇金鼎盈定增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。《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为227,360,148.23份基金份额，相关募集业经北京兴华会计师事务所[2016]京会兴浙分验字第68000100号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式基金，基金合同生效后，本基金设一个18个月的封闭期，在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额；封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金，并更名为浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF），投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。存续期为不定期。自2018年6月7日起，

本基金转换为上市开放式基金（LOF），由原来“浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金”名称变更为“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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中国债券总指数收益率×30%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况、2025年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“企业会计准则”）编制，同时参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准

则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未

偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该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。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 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

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，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。

##### (b) 后续计量

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以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。

##### - 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产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。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

##### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。

信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得

计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入证券出借业务利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益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确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在封闭期内，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数不得少于1次，年度收益分配比例不得低于基金年度可供分配利润的90%，若《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》生效不满3个月可不进行收益分配。转换为上市开放式基金（LOF）后，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。本基金封闭期内的收益分配方式为现金分红。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，基金份额持有人选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式。具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、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基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、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、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

#### 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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面

推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)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。

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。

d)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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	992,867.76	2,553,306.23
等于：本金	992,735.44	2,552,963.37
加：应计利息	132.32	342.86
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	992,867.76	2,553,306.23

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	8,029,828.05	-	8,003,593.00	-26,235.05

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		8,029,828.05	-	8,003,593.00	-26,235.05
项目		上年度末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		7,931,608.26	-	7,949,274.93	17,666.67
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		7,931,608.26	-	7,949,274.93	17,666.67

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末及上年度末，未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金在本报告期末及上年度末，未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在本报告期末及上年度末，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金在本报告期末及上年度末，未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	50.75	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	236,121.32	382,537.94
其中：交易所市场	236,121.32	382,537.94
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	-	3,481.66
合计	236,172.07	386,019.60

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,978,471.10	6,978,471.10
本期申购	2,262,934.73	2,262,934.73
本期赎回（以“-”号填列）	-3,821,254.16	-3,821,254.16
本期末	5,420,151.67	5,420,151.67

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 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	5,086,726.64	-2,300,187.34	2,786,539.30
本期期初	5,086,726.64	-2,300,187.34	2,786,539.30
本期利润	1,983,062.76	-43,901.72	1,939,161.04
本期基金份额交易产生的变动数	-1,518,024.14	349,726.17	-1,168,297.97
其中：基金申购款	1,944,703.31	-711,957.96	1,232,745.35
基金赎回款	-3,462,727.45	1,061,684.13	-2,401,043.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,551,765.26	-1,994,362.89	3,557,402.37

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
活期存款利息收入	5,713.24	13,472.29
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	754.89	842.85
其他	78.14	136.78
合计	6,546.27	14,451.92

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
卖出股票成交总额	375,606,663.79	84,977,258.10
减：卖出股票成本总额	372,975,196.64	84,975,492.60
减：交易费用	562,153.62	148,310.05
买卖股票差价收入	2,069,313.53	-146,544.55

#### 7.4.7.11 基金投资收益

本基金在本报告期及上年度可比期间，未进行基金投资。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

本基金在本报告期及上年度可比期间内均无债券投资收益。

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期及上年度可比期间，未持有资产支持证券。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期及上年度可比期间，未持有贵金属。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期及上年度可比期间，未持有衍生工具。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期及上年度可比期间，未持有其他衍生工具。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日
股票投资产生的股利收益	24,207.44	75,335.91
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	24,207.44	75,335.91

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年12	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12

	月31日	月31日
1.交易性金融资产	-43,901.72	-16,707.06
——股票投资	-43,901.72	-16,707.06
——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	-43,901.72	-16,707.06

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
基金赎回费收入	17,376.83	3,311.67
合计	17,376.83	3,311.67

#### 7.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期及上年度可比期间，未产生信用减值损失。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
审计费用	-	3,481.66

信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	270.00	276.00
其他	-	-120,000.00
合计	270.00	-116,242.34

注：1、本基金处于“迷你基金”期间的信息披露费、审计费等固定费用由本基金的基金管理人承担。

2、其他为上市费。

#### 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构
浙商期货有限公司	受基金管理人母公司控制的公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成	成交金额	占当期 股票成

		交总额的比例		交总额的比例
浙商证券股份有限公司	-	-	4,710,685.99	2.79%

注：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。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

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回购交易。

#### 7.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31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	4,455.76	4.69%	-	-

注：1、本基金在本报告期内，无应支付关联方的佣金。本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

2、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券

登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

3、2024年7月1日前，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。自2024年7月1日起，券商仅为本基金提供交易单元租用以及研究服务。

#### 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 2025年01月01日至20 25年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	115,253.33	117,804.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	54,381.66	55,937.87
应支付基金管理人的净管理费	60,871.67	61,866.78

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费自基金合同生效之日起，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	19,208.96	19,634.15

注：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：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

本基金在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固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 7.4.10.4.2 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

本基金在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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内，基金管理人均未持有本基金。

##### 7.4.10.5.2 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，未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 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 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商	992,867.76	5,713.24	2,553,306.23	13,472.29

银行股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

注：本基金的货币资金由基金托管人中国工商银行股份有限公司进行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于浙商期货有限公司的结算账户和保证金账户中，结算备付金不计息，存出保证金不计息。于2025年12月31日，本基金的结算备付金余额为1,001.00元，无存出保证金余额。于2024年12月31日，本基金的结算备付金余额为1,001.00元，无存出保证金余额。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型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。

#### 7.4.12 期末（2025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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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
688012	中微公	2025-12-19	筹划发	272.72	2026-01-05	278.00	2,000	544,895.00	545,440.00	-

	司		行 股 份 购 买 资 产 并 募 集 配 套 资 金							
--	---	--	--	--	--	--	--	--	--	--

### 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2025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2025年12月31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。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金在本报告期末，未参与转融通证券出借业务。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险、利率风险和其他价格风险。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。

#### 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。

本基金管理人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。

#### **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工商银行，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。

##### **7.4.13.2.1 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。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均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**

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

##### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均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**

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### 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 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025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							
货币资金	992,867.76	-	-	-	-	-	992,867.76

结算备付金	255,799.03	-	-	-	-	-	255,799.03
存出保证金	23,376.61	-	-	-	-	-	23,376.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,003,593.00	8,003,593.00
应收申购款	-	-	-	-	-	52,653.00	52,653.00
资产总计	1,272,043.40	-	-	-	-	8,056,246.00	9,328,289.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	104,041.49	104,041.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,018.67	9,018.67
应付托管费	-	-	-	-	-	1,503.13	1,503.13
其他负债	-	-	-	-	-	236,172.07	236,172.07
负债总计	-	-	-	-	-	350,735.36	350,735.36
利率敏感度缺口	1,272,043.40	-	-	-	-	7,705,510.64	8,977,554.04
上年度末 2024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							
货币资金	2,553,306.23	-	-	-	-	-	2,553,306.23
结算备付金	115,915.71	-	-	-	-	-	115,915.71
存出保证金	12,271.34	-	-	-	-	-	12,271.34
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,949,274.93	7,949,274.93
应收申	-	-	-	-	-	347.91	347.91

购款							
资产总计	2,681,493.28	-	-	-	-	7,949,622.84	10,631,116.12
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	468,153.02	468,153.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,228.36	10,228.36
应付托管费	-	-	-	-	-	1,704.74	1,704.74
其他负债	-	-	-	-	-	386,019.60	386,019.60
负债总计	-	-	-	-	-	866,105.72	866,105.72
利率敏感度缺口	2,681,493.28	-	-	-	-	7,083,517.12	9,765,010.40

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末本基金未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

#### 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。

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。

##### 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 2025年12月31日		上年度末 2024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	8,003,593.00	89.15	7,949,274.93	81.41
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	8,003,593.00	89.15	7,949,274.93	81.41

#### 7.4.13.4.3.2 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	1、沪深300指数上涨5%	795,256.03	448,407.25
	2、沪深300指数下跌5%	-795,256.03	-448,407.25

#### 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180天		
分析	风险价值	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	风险价值	-400,899.00	-242,938.29
	合计	-400,899.00	-242,938.29

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

第一层次输入值:在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;

第三层次输入值:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	7,458,153.00	7,949,274.93
第二层次	545,440.00	-
第三层次	-	-
合计	8,003,593.00	7,949,274.93

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和可转换债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间

不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产和负债。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、买入返售金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	8,003,593.00	85.80
	其中：股票	8,003,593.00	85.80
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	1,248,666.79	13.39
8	其他各项资产	76,029.61	0.82

9	合计	9,328,289.40	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

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	6,951,289.00	77.43
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	1,052,304.00	11.72
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	-	-
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	8,003,593.00	89.15

### 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

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	688981	中芯国际	5,000	614,150.00	6.84
2	688012	中微公司	2,000	545,440.00	6.08
3	688256	寒武纪	400	542,220.00	6.04
4	688347	华虹公司	5,000	539,350.00	6.01
5	688498	源杰科技	800	513,592.00	5.72
6	688702	盛科通信	3,600	510,084.00	5.68
7	688375	国博电子	5,000	465,550.00	5.19
8	688041	海光信息	2,000	448,820.00	5.00
9	688002	睿创微纳	4,200	423,360.00	4.72
10	688385	复旦微电	5,500	405,350.00	4.52
11	301611	珂玛科技	4,500	385,785.00	4.30
12	300567	精测电子	4,000	364,800.00	4.06
13	300604	长川科技	3,600	364,716.00	4.06
14	688072	拓荆科技	1,000	330,000.00	3.68
15	002371	北方华创	700	321,356.00	3.58
16	688392	骄成超声	2,800	314,160.00	3.50
17	688147	微导纳米	5,000	313,950.00	3.50
18	688361	中科飞测	2,000	305,980.00	3.41
19	688652	京仪装备	3,000	294,930.00	3.29

## 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	688256	寒武纪	5,163,086.02	52.87
2	601166	兴业银行	4,767,195.00	48.82

3	688041	海光信息	4,556,574.05	46.66
4	601939	建设银行	4,353,082.00	44.58
5	688981	中芯国际	4,286,937.44	43.90
6	601900	南方传媒	4,238,786.00	43.41
7	300454	深信服	3,842,354.36	39.35
8	601138	工业富联	3,392,259.00	34.74
9	300661	圣邦股份	3,372,241.00	34.53
10	688347	华虹公司	3,235,535.12	33.13
11	601288	农业银行	3,045,255.00	31.19
12	300308	中际旭创	3,007,731.00	30.80
13	688702	盛科通信	2,985,250.44	30.57
14	000719	中原传媒	2,938,497.00	30.09
15	300782	卓胜微	2,835,315.00	29.04
16	688111	金山办公	2,823,190.95	28.91
17	688072	拓荆科技	2,779,109.38	28.46
18	600757	长江传媒	2,753,558.00	28.20
19	688205	德科立	2,688,877.79	27.54
20	300502	新易盛	2,613,980.00	26.77
21	300394	天孚通信	2,567,179.00	26.29
22	601009	南京银行	2,553,420.00	26.15
23	001309	德明利	2,506,578.45	25.67
24	688525	佰维存储	2,479,083.96	25.39
25	600919	江苏银行	2,478,580.00	25.38
26	688536	思瑞浦	2,473,358.31	25.33
27	603893	瑞芯微	2,470,736.00	25.30
28	688012	中微公司	2,435,057.98	24.94
29	688498	源杰科技	2,365,557.08	24.22
30	300476	胜宏科技	2,220,633.00	22.74
31	300378	鼎捷数智	2,160,599.00	22.13
32	002472	双环传动	2,157,152.00	22.09
33	002371	北方华创	2,124,341.34	21.75

34	601689	拓普集团	2,086,245.00	21.36
35	002851	麦格米特	2,081,699.00	21.32
36	688361	中科飞测	2,071,323.53	21.21
37	688521	芯原股份	2,065,881.58	21.16
38	603019	中科曙光	2,040,497.00	20.90
39	002938	鹏鼎控股	2,014,554.00	20.63
40	603986	兆易创新	1,966,096.00	20.13
41	601169	北京银行	1,965,820.00	20.13
42	601098	中南传媒	1,957,668.00	20.05
43	003021	兆威机电	1,890,492.00	19.36
44	600015	华夏银行	1,887,371.00	19.33
45	688052	纳芯微	1,885,881.35	19.31
46	300007	汉威科技	1,848,767.00	18.93
47	000063	中兴通讯	1,836,186.00	18.80
48	002241	歌尔股份	1,807,979.00	18.51
49	300442	润泽科技	1,806,820.00	18.50
50	600900	长江电力	1,804,034.00	18.47
51	300433	蓝思科技	1,783,108.00	18.26
52	688615	合合信息	1,781,839.44	18.25
53	601998	中信银行	1,771,339.00	18.14
54	688392	骄成超声	1,633,639.97	16.73
55	601728	中国电信	1,623,907.00	16.63
56	300475	香农芯创	1,607,509.00	16.46
57	603416	信捷电气	1,593,168.00	16.32
58	301308	江波龙	1,588,238.00	16.26
59	688095	福昕软件	1,586,179.66	16.24
60	601811	新华文轩	1,548,279.00	15.86
61	688652	京仪装备	1,542,177.84	15.79
62	002475	立讯精密	1,526,467.00	15.63
63	000977	浪潮信息	1,510,378.00	15.47
64	601100	恒立液压	1,502,378.00	15.39

65	600438	通威股份	1,498,951.00	15.35
66	605488	福莱新材	1,498,027.88	15.34
67	603296	华勤技术	1,490,571.00	15.26
68	688766	普冉股份	1,479,152.17	15.15
69	000032	深桑达A	1,476,587.00	15.12
70	600519	贵州茅台	1,449,185.00	14.84
71	601928	凤凰传媒	1,432,640.00	14.67
72	688337	普源精电	1,424,850.47	14.59
73	300170	汉得信息	1,412,392.05	14.46
74	601328	交通银行	1,410,900.00	14.45
75	688486	龙迅股份	1,407,136.58	14.41
76	300203	聚光科技	1,398,263.00	14.32
77	688365	光云科技	1,380,737.12	14.14
78	688500	慧辰股份	1,349,769.31	13.82
79	688691	灿芯股份	1,335,277.85	13.67
80	688668	鼎通科技	1,328,384.30	13.60
81	600941	中国移动	1,318,696.00	13.50
82	600183	生益科技	1,318,096.00	13.50
83	601865	福莱特	1,285,928.00	13.17
84	002384	东山精密	1,252,067.00	12.82
85	000997	新大陆	1,244,449.00	12.74
86	688627	精智达	1,241,258.25	12.71
87	605208	永茂泰	1,240,643.00	12.70
88	688018	乐鑫科技	1,218,039.57	12.47
89	603882	金域医学	1,209,767.00	12.39
90	300383	光环新网	1,209,734.00	12.39
91	002126	银轮股份	1,185,897.00	12.14
92	688385	复旦微电	1,184,852.58	12.13
93	601211	国泰海通	1,179,667.00	12.08
94	600276	恒瑞医药	1,164,882.00	11.93
95	601698	中国卫通	1,156,011.00	11.84

96	600016	民生银行	1,151,700.00	11.79
97	300687	赛意信息	1,142,350.00	11.70
98	300738	奥飞数据	1,124,843.00	11.52
99	600588	用友网络	1,117,802.00	11.45
100	603859	能科科技	1,117,764.00	11.45
101	601595	上海电影	1,112,520.00	11.39
102	603171	税友股份	1,112,017.00	11.39
103	002916	深南电路	1,110,899.00	11.38
104	002281	光迅科技	1,097,452.00	11.24
105	688692	达梦数据	1,083,683.17	11.10
106	688220	翱捷科技	1,082,914.26	11.09
107	688313	仕佳光子	1,075,658.39	11.02
108	600036	招商银行	1,072,434.00	10.98
109	002466	天齐锂业	1,056,466.00	10.82
110	600879	航天电子	1,047,838.00	10.73
111	002458	益生股份	1,046,910.00	10.72
112	688608	恒玄科技	1,046,636.67	10.72
113	688332	中科蓝讯	1,044,159.28	10.69
114	605319	无锡振华	1,043,088.00	10.68
115	002714	牧原股份	1,036,558.00	10.62
116	300498	温氏股份	1,033,153.00	10.58
117	688147	微导纳米	1,031,217.32	10.56
118	688019	安集科技	1,018,011.63	10.43
119	300607	拓斯达	1,002,236.00	10.26
120	688311	盟升电子	1,000,734.82	10.25
121	688507	索辰科技	988,942.56	10.13
122	301099	雅创电子	947,743.90	9.71
123	603901	永创智能	927,661.00	9.50
124	300624	万兴科技	916,769.00	9.39
125	002965	祥鑫科技	916,489.00	9.39
126	000887	中鼎股份	896,520.53	9.18

127	002050	三花智控	894,402.00	9.16
128	601088	中国神华	893,163.00	9.15
129	002891	中宠股份	866,201.00	8.87
130	603533	掌阅科技	854,966.00	8.76
131	688678	福立旺	850,166.16	8.71
132	300953	震裕科技	849,735.00	8.70
133	603918	金桥信息	846,044.00	8.66
134	601838	成都银行	839,303.00	8.60
135	300229	拓尔思	832,734.00	8.53
136	601456	国联民生	830,740.00	8.51
137	000880	潍柴重机	830,548.00	8.51
138	002970	锐明技术	810,454.00	8.30
139	600585	海螺水泥	810,291.00	8.30
140	688112	鼎阳科技	805,576.52	8.25
141	002149	西部材料	804,864.00	8.24
142	688800	瑞可达	804,747.32	8.24
143	300604	长川科技	801,454.00	8.21
144	688066	航天宏图	790,984.90	8.10
145	688047	龙芯中科	789,629.97	8.09
146	301392	汇成真空	789,461.00	8.08
147	600048	保利发展	788,636.00	8.08
148	301556	托普云农	787,659.00	8.07
149	300274	阳光电源	786,420.00	8.05
150	002664	信质集团	781,405.00	8.00
151	600536	中国软件	780,371.00	7.99
152	600118	中国卫星	779,630.00	7.98
153	603039	泛微网络	773,554.00	7.92
154	301611	珂玛科技	772,174.45	7.91
155	300870	欧陆通	770,185.00	7.89
156	601818	光大银行	768,000.00	7.86
157	688158	优刻得	767,903.74	7.86

158	000932	华菱钢铁	766,933.00	7.85
159	688249	晶合集成	765,327.38	7.84
160	603166	福达股份	764,469.00	7.83
161	300567	精测电子	758,730.00	7.77
162	301165	锐捷网络	757,871.64	7.76
163	688333	铂力特	750,176.53	7.68
164	688539	高华科技	739,998.37	7.58
165	002368	太极股份	737,739.00	7.55
166	300253	卫宁健康	734,411.00	7.52
167	603698	航天工程	728,934.00	7.46
168	002987	京北方	725,207.00	7.43
169	002460	赣锋锂业	723,758.00	7.41
170	300680	隆盛科技	717,837.00	7.35
171	603579	荣泰健康	717,779.00	7.35
172	000560	我爱我家	714,875.00	7.32
173	688123	聚辰股份	711,051.45	7.28
174	002335	科华数据	708,697.00	7.26
175	003033	征和工业	706,687.00	7.24
176	603809	豪能股份	704,340.90	7.21
177	688636	智明达	689,482.87	7.06
178	002594	比亚迪	686,865.00	7.03
179	688025	杰普特	679,683.45	6.96
180	603179	新泉股份	671,007.00	6.87
181	603477	巨星农牧	664,758.00	6.81
182	688787	海天瑞声	663,003.13	6.79
183	002779	中坚科技	655,840.00	6.72
184	688600	皖仪科技	651,819.47	6.68
185	688037	芯源微	650,749.39	6.66
186	601360	三六零	650,098.00	6.66
187	300674	宇信科技	648,031.00	6.64
188	688322	奥比中光	646,559.45	6.62

189	301162	国能日新	639,365.00	6.55
190	301413	安培龙	632,432.00	6.48
191	605333	沪光股份	631,668.00	6.47
192	688246	嘉和美康	630,694.14	6.46
193	300803	指南针	628,408.00	6.44
194	300638	广和通	625,410.00	6.40
195	688676	金盘科技	617,397.89	6.32
196	002739	万达电影	616,481.00	6.31
197	300762	上海瀚讯	613,168.00	6.28
198	300785	值得买	610,995.00	6.26
199	300857	协创数据	608,547.00	6.23
200	000651	格力电器	605,854.00	6.20
201	002858	力盛体育	604,977.00	6.20
202	300364	中文在线	582,912.00	5.97
203	603678	火炬电子	562,134.00	5.76
204	601888	中国中免	560,760.00	5.74
205	300568	星源材质	559,809.00	5.73
206	688353	华盛锂电	549,598.95	5.63
207	300054	鼎龙股份	540,138.00	5.53
208	301377	鼎泰高科	538,088.00	5.51
209	688375	国博电子	533,302.89	5.46
210	300408	三环集团	532,356.00	5.45
211	688778	厦钨新能	522,618.95	5.35
212	688258	卓易信息	522,007.00	5.35
213	603119	浙江荣泰	521,163.00	5.34
214	603270	金帝股份	515,654.00	5.28
215	600480	凌云股份	512,598.00	5.25
216	601988	中国银行	507,000.00	5.19
217	688401	路维光电	504,800.68	5.17
218	300458	全志科技	504,416.00	5.17
219	002993	奥海科技	502,687.00	5.15

220	600782	新钢股份	497,080.00	5.09
221	002045	国光电器	493,059.00	5.05
222	603345	安井食品	492,755.00	5.05
223	000661	长春高新	489,687.00	5.01
224	301421	波长光电	487,535.00	4.99
225	688411	海博思创	481,642.76	4.93
226	688006	杭可科技	479,766.00	4.91
227	301383	天键股份	476,465.00	4.88
228	301101	明月镜片	475,689.00	4.87
229	688503	聚和材料	468,128.40	4.79
230	601949	中国出版	457,606.00	4.69
231	002245	蔚蓝锂芯	456,199.00	4.67
232	002299	圣农发展	455,845.00	4.67
233	300014	亿纬锂能	454,884.00	4.66
234	300652	雷迪克	454,488.00	4.65
235	300450	先导智能	448,026.00	4.59
236	688409	富创精密	446,526.56	4.57
237	002311	海大集团	444,476.00	4.55
238	603228	景旺电子	442,071.00	4.53
239	603659	璞泰来	441,890.00	4.53
240	600353	旭光电子	441,750.00	4.52
241	002294	信立泰	435,741.00	4.46
242	601066	中信建投	433,997.00	4.44
243	600926	杭州银行	430,920.00	4.41
244	601658	邮储银行	429,600.00	4.40
245	002624	完美世界	428,040.00	4.38
246	600073	光明肉业	425,298.00	4.36
247	001283	豪鹏科技	424,804.00	4.35
248	002130	沃尔核材	419,948.00	4.30
249	000513	丽珠集团	418,943.00	4.29
250	002599	盛通股份	418,000.00	4.28

251	688601	力芯微	417,803.60	4.28
252	300676	华大基因	417,767.00	4.28
253	300788	中信出版	417,372.00	4.27
254	600025	华能水电	417,045.00	4.27
255	600702	舍得酒业	416,866.00	4.27
256	000519	中兵红箭	416,000.00	4.26
257	002129	TCL中环	415,998.00	4.26
258	600419	天润乳业	415,059.00	4.25
259	605090	九丰能源	414,610.00	4.25
260	002103	广博股份	413,529.00	4.23
261	688097	博众精工	413,359.50	4.23
262	301231	荣信文化	413,219.00	4.23
263	000821	ST京机	412,792.00	4.23
264	688002	睿创微纳	412,161.78	4.22
265	688515	裕太微	411,851.91	4.22
266	688599	天合光能	410,977.75	4.21
267	600732	爱旭股份	409,674.00	4.20
268	688213	思特威	409,456.52	4.19
269	688270	臻镭科技	407,364.76	4.17
270	000065	北方国际	406,707.00	4.16
271	603200	上海洗霸	406,299.00	4.16
272	688603	天承科技	405,837.20	4.16
273	002422	科伦药业	405,735.00	4.15
274	605111	新洁能	402,665.00	4.12
275	002843	泰嘉股份	402,105.00	4.12
276	603341	龙旗科技	401,694.00	4.11
277	300973	立高食品	400,632.00	4.10
278	000733	振华科技	399,562.00	4.09
279	300426	华智数媒	399,352.00	4.09
280	301011	华立科技	398,208.00	4.08
281	002064	华峰化学	398,186.00	4.08

282	600586	金晶科技	396,995.89	4.07
283	601229	上海银行	394,925.00	4.04
284	600760	中航沈飞	393,893.00	4.03
285	002020	京新药业	391,945.00	4.01
286	600801	华新建材	391,900.00	4.01
287	600600	青岛啤酒	391,115.00	4.01
288	600990	四创电子	390,807.00	4.00
289	600699	均胜电子	390,520.00	4.00
290	001979	招商蛇口	390,225.00	4.00
291	688297	中无人机	389,844.75	3.99
292	600718	东软集团	389,267.00	3.99
293	301349	信德新材	388,822.00	3.98
294	000892	欢瑞世纪	388,592.00	3.98
295	300271	华宇软件	388,032.00	3.97
296	688568	中科星图	388,011.61	3.97
297	688005	容百科技	387,975.00	3.97
298	301005	超捷股份	387,779.00	3.97
299	002008	大族激光	387,524.00	3.97
300	300182	捷成股份	387,110.00	3.96
301	300082	奥克股份	386,672.00	3.96
302	603305	旭升集团	385,879.00	3.95
303	301511	德福科技	385,746.00	3.95
304	688268	华特气体	385,120.39	3.94
305	300570	太辰光	383,956.00	3.93
306	002812	恩捷股份	380,663.00	3.90
307	300474	景嘉微	378,517.00	3.88
308	301018	申菱环境	376,631.00	3.86
309	300102	乾照光电	376,559.00	3.86
310	688602	康鹏科技	376,413.37	3.85
311	300148	天舟文化	375,960.00	3.85
312	000628	高新发展	375,179.00	3.84

313	600029	南方航空	375,000.46	3.84
314	600596	新安股份	374,895.00	3.84
315	300059	东方财富	374,043.00	3.83
316	000928	中钢国际	373,760.00	3.83
317	688368	晶丰明源	370,908.08	3.80
318	603666	亿嘉和	369,830.00	3.79
319	688088	虹软科技	368,930.57	3.78
320	002043	兔宝宝	368,310.00	3.77
321	603197	保隆科技	367,137.00	3.76
322	601952	苏垦农发	366,894.00	3.76
323	600970	中材国际	366,852.00	3.76
324	688320	禾川科技	366,055.04	3.75
325	300654	世纪天鸿	365,121.00	3.74
326	603103	横店影视	364,458.00	3.73
327	301297	富乐德	363,534.00	3.72
328	601857	中国石油	359,165.00	3.68
329	601117	中国化学	358,018.00	3.67
330	301236	软通动力	356,208.00	3.65
331	000786	北新建材	356,101.00	3.65
332	002597	金禾实业	355,730.00	3.64
333	300724	捷佳伟创	355,467.00	3.64
334	301617	博苑股份	354,157.19	3.63
335	600141	兴发集团	353,623.00	3.62
336	300348	长亮科技	353,520.00	3.62
337	002463	沪电股份	351,326.00	3.60
338	600000	浦发银行	350,400.00	3.59
339	002777	久远银海	349,942.00	3.58
340	300769	德方纳米	349,914.00	3.58
341	000725	京东方A	347,995.00	3.56
342	600446	金证股份	347,445.00	3.56
343	300258	精锻科技	345,339.00	3.54

344	300075	数字政通	344,850.00	3.53
345	688472	阿特斯	344,741.15	3.53
346	000957	中通客车	343,084.00	3.51
347	300337	银邦股份	342,346.00	3.51
348	002600	领益智造	338,800.00	3.47
349	002841	视源股份	335,195.00	3.43
350	600938	中国海油	332,397.00	3.40
351	688573	信宇人	332,116.44	3.40
352	688381	帝奥微	331,896.49	3.40
353	603170	宝立食品	329,795.00	3.38
354	603662	柯力传感	329,766.00	3.38
355	002756	永兴材料	326,125.00	3.34
356	301117	佳缘科技	324,251.00	3.32
357	688798	艾为电子	323,682.17	3.31
358	603737	三棵树	323,532.00	3.31
359	000988	华工科技	322,161.00	3.30
360	300666	江丰电子	320,995.00	3.29
361	603308	应流股份	318,626.00	3.26
362	688583	思看科技	317,349.17	3.25
363	002396	星网锐捷	315,656.00	3.23
364	688629	华丰科技	312,905.28	3.20
365	300037	新宙邦	311,517.00	3.19
366	600845	宝信软件	311,343.00	3.19
367	300339	润和软件	308,019.00	3.15
368	603063	禾望电气	307,000.00	3.14
369	603319	美湖股份	305,103.56	3.12
370	300735	光弘科技	304,956.00	3.12
371	601012	隆基绿能	304,914.00	3.12
372	600482	中国动力	303,570.00	3.11
373	688776	国光电气	298,771.88	3.06
374	600426	华鲁恒升	297,515.00	3.05

375	603596	伯特利	294,492.72	3.02
376	601808	中海油服	293,894.00	3.01
377	603444	吉比特	292,147.00	2.99
378	688443	智翔金泰	283,391.49	2.90
379	688176	亚虹医药	282,910.54	2.90
380	688126	沪硅产业	282,600.00	2.89
381	605168	三人行	278,917.90	2.86
382	600584	长电科技	277,089.00	2.84
383	688596	正帆科技	276,540.62	2.83
384	688518	联赢激光	273,203.54	2.80
385	300634	彩讯股份	263,689.00	2.70
386	600867	通化东宝	258,100.00	2.64
387	002074	国轩高科	257,459.00	2.64
388	688559	海目星	256,177.96	2.62
389	600104	上汽集团	255,602.00	2.62
390	000998	隆平高科	254,716.00	2.61
391	300750	宁德时代	252,668.00	2.59
392	688155	先惠技术	247,316.08	2.53
393	688535	华海诚科	246,984.64	2.53
394	600298	安琪酵母	241,695.00	2.48
395	300409	道氏技术	239,023.00	2.45
396	300413	芒果超媒	237,253.00	2.43
397	300244	迪安诊断	233,362.00	2.39
398	601636	旗滨集团	232,719.00	2.38
399	605088	冠盛股份	232,299.00	2.38
400	603288	海天味业	231,566.00	2.37
401	688234	天岳先进	228,525.58	2.34
402	688062	迈威生物	227,963.42	2.33
403	000400	许继电气	222,103.00	2.27
404	688232	新点软件	221,565.85	2.27
405	603920	世运电路	218,946.00	2.24

406	002049	紫光国微	218,414.00	2.24
407	300130	新国都	217,088.00	2.22
408	300827	上能电气	214,999.20	2.20
409	688071	华依科技	214,445.13	2.20
410	300873	海晨股份	213,880.00	2.19
411	301398	星源卓镁	213,431.00	2.19
412	001282	三联锻造	213,313.00	2.18
413	300068	南都电源	212,184.00	2.17
414	300115	长盈精密	210,886.00	2.16
415	300814	中富电路	210,508.00	2.16
416	002765	蓝黛科技	210,000.00	2.15
417	600418	江淮汽车	209,760.00	2.15
418	600577	精达股份	208,327.00	2.13
419	000682	东方电子	207,924.00	2.13
420	688235	百济神州	207,846.00	2.13
421	300918	南山智尚	206,795.35	2.12
422	688717	艾罗能源	206,165.41	2.11
423	300073	当升科技	205,644.00	2.11
424	688279	峰昭科技	204,633.57	2.10
425	300571	平治信息	204,540.00	2.09
426	002913	奥士康	203,782.00	2.09
427	603728	鸣志电器	203,739.00	2.09
428	001301	尚太科技	203,242.00	2.08
429	603005	晶方科技	202,692.00	2.08
430	300748	金力永磁	199,954.00	2.05
431	300548	长芯博创	199,245.00	2.04
432	688552	航天南湖	198,121.40	2.03
433	300092	科新机电	197,988.00	2.03
434	300223	北京君正	197,561.00	2.02
435	300100	双林股份	196,288.00	2.01
436	002273	水晶光电	195,996.00	2.01

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	688256	寒武纪	5,038,764.09	51.60
2	601166	兴业银行	4,805,726.00	49.21
3	601939	建设银行	4,340,004.00	44.44
4	688041	海光信息	4,320,289.40	44.24
5	601900	南方传媒	4,276,659.00	43.80
6	300454	深信服	3,865,396.00	39.58
7	688981	中芯国际	3,669,064.55	37.57
8	601138	工业富联	3,640,721.00	37.28
9	300661	圣邦股份	3,369,079.70	34.50
10	300308	中际旭创	3,105,279.94	31.80
11	601288	农业银行	3,055,490.00	31.29
12	000719	中原传媒	2,996,036.53	30.68
13	688347	华虹公司	2,917,745.39	29.88
14	688702	盛科通信	2,883,473.23	29.53
15	688205	德科立	2,852,303.30	29.21
16	300782	卓胜微	2,845,765.00	29.14
17	600757	长江传媒	2,790,239.00	28.57
18	001309	德明利	2,721,015.00	27.86
19	688111	金山办公	2,712,535.69	27.78
20	601009	南京银行	2,543,630.00	26.05
21	603893	瑞芯微	2,514,854.40	25.75
22	300502	新易盛	2,511,871.00	25.72

23	600919	江苏银行	2,475,049.00	25.35
24	688072	拓荆科技	2,456,840.55	25.16
25	688536	思瑞浦	2,454,763.29	25.14
26	688525	佰维存储	2,437,553.64	24.96
27	300394	天孚通信	2,401,297.80	24.59
28	300378	鼎捷数智	2,353,766.00	24.10
29	300476	胜宏科技	2,319,446.00	23.75
30	002241	歌尔股份	2,275,869.00	23.31
31	688521	芯原股份	2,234,956.04	22.89
32	000063	中兴通讯	2,203,644.00	22.57
33	300433	蓝思科技	2,183,214.00	22.36
34	603019	中科曙光	2,162,712.00	22.15
35	002472	双环传动	2,141,134.00	21.93
36	601689	拓普集团	2,085,061.00	21.35
37	002851	麦格米特	2,064,411.00	21.14
38	002938	鹏鼎控股	2,056,541.00	21.06
39	603986	兆易创新	2,002,418.00	20.51
40	601098	中南传媒	1,972,037.00	20.19
41	002475	立讯精密	1,954,096.00	20.01
42	601169	北京银行	1,950,205.00	19.97
43	300442	润泽科技	1,878,020.00	19.23
44	003021	兆威机电	1,873,533.00	19.19
45	688012	中微公司	1,869,768.41	19.15
46	300007	汉威科技	1,857,509.00	19.02
47	600015	华夏银行	1,845,435.00	18.90
48	688052	纳芯微	1,830,240.99	18.74
49	688615	合合信息	1,810,936.68	18.55
50	688361	中科飞测	1,787,555.94	18.31
51	600900	长江电力	1,781,513.00	18.24
52	601998	中信银行	1,778,720.00	18.22
53	688498	源杰科技	1,778,000.52	18.21

54	002371	北方华创	1,735,556.00	17.77
55	301308	江波龙	1,727,679.00	17.69
56	688220	翱捷科技	1,661,405.11	17.01
57	601728	中国电信	1,637,516.00	16.77
58	688095	福昕软件	1,623,522.66	16.63
59	000977	浪潮信息	1,610,356.00	16.49
60	300475	香农芯创	1,589,348.00	16.28
61	603416	信捷电气	1,573,268.00	16.11
62	601811	新华文轩	1,558,022.00	15.96
63	000032	深桑达A	1,540,939.00	15.78
64	605488	福莱新材	1,511,788.10	15.48
65	300383	光环新网	1,511,211.00	15.48
66	688766	普冉股份	1,502,183.81	15.38
67	603296	华勤技术	1,501,550.00	15.38
68	688500	慧辰股份	1,491,386.78	15.27
69	601928	凤凰传媒	1,452,514.00	14.87
70	600519	贵州茅台	1,445,229.00	14.80
71	688337	普源精电	1,431,212.93	14.66
72	300170	汉得信息	1,416,773.00	14.51
73	601328	交通银行	1,415,325.00	14.49
74	600438	通威股份	1,409,467.00	14.43
75	601100	恒立液压	1,408,678.00	14.43
76	688365	光云科技	1,406,862.09	14.41
77	300203	聚光科技	1,391,840.00	14.25
78	002281	光迅科技	1,348,904.00	13.81
79	600183	生益科技	1,333,867.00	13.66
80	600941	中国移动	1,326,409.00	13.58
81	688486	龙迅股份	1,321,455.48	13.53
82	605208	永茂泰	1,303,216.60	13.35
83	688627	精智达	1,297,852.71	13.29
84	688691	灿芯股份	1,294,200.68	13.25

85	002384	东山精密	1,274,057.00	13.05
86	688392	骄成超声	1,257,757.99	12.88
87	688018	乐鑫科技	1,241,535.14	12.71
88	600588	用友网络	1,239,073.00	12.69
89	601698	中国卫通	1,237,482.00	12.67
90	000997	新大陆	1,229,386.00	12.59
91	601865	福莱特	1,224,549.00	12.54
92	002126	银轮股份	1,220,491.00	12.50
93	603882	金域医学	1,215,377.00	12.45
94	600879	航天电子	1,213,589.00	12.43
95	688668	鼎通科技	1,197,484.66	12.26
96	600276	恒瑞医药	1,194,571.00	12.23
97	603859	能科科技	1,187,192.00	12.16
98	688652	京仪装备	1,176,544.82	12.05
99	601211	国泰海通	1,175,720.00	12.04
100	603171	税友股份	1,160,992.00	11.89
101	600016	民生银行	1,160,000.00	11.88
102	300687	赛意信息	1,152,946.72	11.81
103	300738	奥飞数据	1,138,593.00	11.66
104	301165	锐捷网络	1,127,425.00	11.55
105	688692	达梦数据	1,090,055.95	11.16
106	600036	招商银行	1,081,487.00	11.08
107	601595	上海电影	1,080,684.00	11.07
108	002714	牧原股份	1,079,593.00	11.06
109	688608	恒玄科技	1,072,637.12	10.98
110	605319	无锡振华	1,061,106.00	10.87
111	002149	西部材料	1,058,047.00	10.84
112	300607	拓斯达	1,054,951.20	10.80
113	002466	天齐锂业	1,050,609.00	10.76
114	300498	温氏股份	1,050,148.00	10.75
115	002916	深南电路	1,038,867.72	10.64

116	688311	盟升电子	1,029,553.25	10.54
117	688019	安集科技	1,029,390.56	10.54
118	688313	仕佳光子	1,027,731.22	10.52
119	002458	益生股份	987,883.00	10.12
120	688507	索辰科技	975,507.83	9.99
121	300870	欧陆通	969,042.00	9.92
122	603901	永创智能	968,733.00	9.92
123	300624	万兴科技	943,287.00	9.66
124	688332	中科蓝讯	936,245.08	9.59
125	002050	三花智控	909,749.00	9.32
126	002965	祥鑫科技	907,782.00	9.30
127	301099	雅创电子	885,412.50	9.07
128	601088	中国神华	881,175.00	9.02
129	603533	掌阅科技	863,075.00	8.84
130	000880	潍柴重机	858,015.00	8.79
131	688676	金盘科技	852,228.50	8.73
132	600118	中国卫星	851,788.00	8.72
133	000887	中鼎股份	851,127.00	8.72
134	688112	鼎阳科技	850,309.05	8.71
135	002597	金禾实业	843,023.12	8.63
136	002891	中宠股份	842,647.00	8.63
137	601456	国联民生	839,668.00	8.60
138	601838	成都银行	833,769.00	8.54
139	688066	航天宏图	832,256.70	8.52
140	600585	海螺水泥	820,842.00	8.41
141	603918	金桥信息	817,720.00	8.37
142	603166	福达股份	816,112.00	8.36
143	301392	汇成真空	806,907.00	8.26
144	603039	泛微网络	801,851.00	8.21
145	603698	航天工程	799,222.00	8.18
146	688678	福立旺	798,851.46	8.18

147	300229	拓尔思	795,363.00	8.15
148	600048	保利发展	794,279.00	8.13
149	688158	优刻得	790,136.86	8.09
150	688539	高华科技	789,054.46	8.08
151	000932	华菱钢铁	786,610.00	8.06
152	002970	锐明技术	783,554.00	8.02
153	688333	铂力特	778,774.18	7.98
154	688800	瑞可达	777,756.90	7.96
155	300274	阳光电源	761,675.00	7.80
156	688047	龙芯中科	756,232.16	7.74
157	601818	光大银行	755,900.00	7.74
158	002335	科华数据	755,094.00	7.73
159	002664	信质集团	751,397.00	7.69
160	002987	京北方	744,153.00	7.62
161	300953	震裕科技	742,809.00	7.61
162	603579	荣泰健康	742,059.00	7.60
163	300253	卫宁健康	741,829.70	7.60
164	600536	中国软件	741,728.00	7.60
165	301556	托普云农	739,305.00	7.57
166	002368	太极股份	739,263.00	7.57
167	688636	智明达	737,203.55	7.55
168	002045	国光电器	730,695.00	7.48
169	000560	我爱我家	725,593.00	7.43
170	688385	复旦微电	723,346.79	7.41
171	688322	奥比中光	714,861.72	7.32
172	603477	巨星农牧	708,554.00	7.26
173	002460	赣锋锂业	707,925.00	7.25
174	688353	华盛锂电	695,462.16	7.12
175	300762	上海瀚讯	694,906.00	7.12
176	688123	聚辰股份	684,747.48	7.01
177	300680	隆盛科技	682,938.00	6.99

178	603179	新泉股份	681,988.00	6.98
179	002779	中坚科技	681,016.00	6.97
180	688249	晶合集成	675,044.60	6.91
181	603809	豪能股份	674,887.00	6.91
182	688025	杰普特	671,677.68	6.88
183	688147	微导纳米	667,026.85	6.83
184	002594	比亚迪	661,513.00	6.77
185	003033	征和工业	656,969.00	6.73
186	688600	皖仪科技	653,204.18	6.69
187	300674	宇信科技	653,012.00	6.69
188	300803	指南针	638,898.00	6.54
189	688787	海天瑞声	637,825.06	6.53
190	688246	嘉和美康	636,299.42	6.52
191	300857	协创数据	636,104.00	6.51
192	300750	宁德时代	633,204.00	6.48
193	601360	三六零	627,000.00	6.42
194	301162	国能日新	624,813.00	6.40
195	603197	保隆科技	624,525.00	6.40
196	300785	值得买	619,785.00	6.35
197	605333	沪光股份	614,298.00	6.29
198	301413	安培龙	611,216.00	6.26
199	002993	奥海科技	606,798.00	6.21
200	002858	力盛体育	599,226.00	6.14
201	002739	万达电影	598,699.00	6.13
202	300638	广和通	587,057.00	6.01
203	000651	格力电器	586,830.00	6.01
204	301377	鼎泰高科	584,793.00	5.99
205	688037	芯源微	571,323.10	5.85
206	300568	星源材质	562,155.00	5.76
207	600104	上汽集团	555,459.00	5.69
208	688778	厦钨新能	547,138.57	5.60

209	600480	凌云股份	545,429.00	5.59
210	603678	火炬电子	544,821.00	5.58
211	601888	中国中免	541,910.00	5.55
212	300364	中文在线	536,585.00	5.49
213	300054	鼎龙股份	529,982.00	5.43
214	603270	金帝股份	516,295.00	5.29
215	603119	浙江荣泰	514,357.00	5.27
216	688258	卓易信息	504,776.43	5.17
217	000661	长春高新	503,233.00	5.15
218	601988	中国银行	503,200.00	5.15
219	600782	新钢股份	502,800.00	5.15
220	603345	安井食品	495,989.00	5.08
221	300570	太辰光	495,119.00	5.07
222	300652	雷迪克	494,903.00	5.07
223	688008	澜起科技	492,915.80	5.05
224	688798	艾为电子	489,644.74	5.01
225	301421	波长光电	484,898.00	4.97
226	301101	明月镜片	484,247.00	4.96
227	688270	臻镭科技	474,728.95	4.86
228	603659	璞泰来	473,827.00	4.85
229	002311	海大集团	471,413.00	4.83
230	300458	全志科技	468,956.00	4.80
231	300408	三环集团	467,948.00	4.79
232	600926	杭州银行	467,946.00	4.79
233	688411	海博思创	467,676.30	4.79
234	002245	蔚蓝锂芯	466,037.00	4.77
235	300450	先导智能	464,870.00	4.76
236	002294	信立泰	464,239.00	4.75
237	688503	聚和材料	461,849.22	4.73
238	688006	杭可科技	461,247.91	4.72
239	002299	圣农发展	460,798.00	4.72

240	688401	路维光电	459,934.51	4.71
241	605090	九丰能源	459,300.00	4.70
242	301511	德福科技	449,122.00	4.60
243	301383	天键股份	448,420.00	4.59
244	688629	华丰科技	445,484.41	4.56
245	600353	旭光电子	443,497.00	4.54
246	601949	中国出版	441,457.00	4.52
247	600073	光明肉业	440,623.29	4.51
248	600419	天润乳业	440,171.00	4.51
249	002103	广博股份	438,564.00	4.49
250	688568	中科星图	435,044.73	4.46
251	002624	完美世界	434,270.00	4.45
252	688409	富创精密	433,218.14	4.44
253	001283	豪鹏科技	433,197.00	4.44
254	601658	邮储银行	432,800.00	4.43
255	601066	中信建投	429,812.00	4.40
256	002843	泰嘉股份	426,982.00	4.37
257	688097	博众精工	426,123.51	4.36
258	301018	申菱环境	424,201.00	4.34
259	688515	裕太微	422,350.31	4.33
260	600732	爱旭股份	421,792.00	4.32
261	000821	ST京机	419,982.00	4.30
262	300014	亿纬锂能	418,800.00	4.29
263	000519	中兵红箭	417,988.00	4.28
264	000065	北方国际	417,176.30	4.27
265	600025	华能水电	417,151.00	4.27
266	603228	景旺电子	416,212.00	4.26
267	000513	丽珠集团	415,652.00	4.26
268	002599	盛通股份	415,068.00	4.25
269	300676	华大基因	414,772.00	4.25
270	600702	舍得酒业	413,414.00	4.23

271	603200	上海洗霸	412,744.00	4.23
272	688601	力芯微	412,438.96	4.22
273	000628	高新发展	409,570.00	4.19
274	301011	华立科技	408,082.00	4.18
275	002129	TCL中环	408,000.00	4.18
276	000733	振华科技	407,565.00	4.17
277	605111	新洁能	406,403.00	4.16
278	603341	龙旗科技	404,359.00	4.14
279	002020	京新药业	404,210.00	4.14
280	002422	科伦药业	404,004.00	4.14
281	300148	天舟文化	402,502.00	4.12
282	300788	中信出版	401,749.00	4.11
283	300973	立高食品	399,373.00	4.09
284	688005	容百科技	399,220.53	4.09
285	600801	华新建材	398,962.00	4.09
286	603305	旭升集团	398,596.00	4.08
287	601229	上海银行	398,542.00	4.08
288	002008	大族激光	397,621.00	4.07
289	300567	精测电子	397,003.00	4.07
290	002130	沃尔核材	394,893.00	4.04
291	600600	青岛啤酒	393,961.00	4.03
292	688213	思特威	393,865.24	4.03
293	300271	华宇软件	392,578.00	4.02
294	688297	中无人机	392,227.65	4.02
295	688368	晶丰明源	391,953.40	4.01
296	600718	东软集团	391,619.00	4.01
297	300604	长川科技	391,074.00	4.00
298	600586	金晶科技	388,399.00	3.98
299	001979	招商蛇口	387,600.00	3.97
300	300769	德方纳米	387,041.00	3.96
301	301005	超捷股份	386,902.00	3.96

302	300182	捷成股份	385,643.00	3.95
303	688268	华特气体	382,877.18	3.92
304	002463	沪电股份	382,240.00	3.91
305	600990	四创电子	382,132.00	3.91
306	600760	中航沈飞	381,452.00	3.91
307	688599	天合光能	381,420.00	3.91
308	300426	华智数媒	381,178.00	3.90
309	002064	华峰化学	379,994.00	3.89
310	300059	东方财富	379,886.00	3.89
311	300474	景嘉微	376,906.00	3.86
312	600970	中材国际	376,000.00	3.85
313	000928	中钢国际	375,799.00	3.85
314	603103	横店影视	373,160.00	3.82
315	301349	信德新材	372,082.00	3.81
316	000892	欢瑞世纪	371,045.00	3.80
317	300082	奥克股份	370,392.00	3.79
318	688088	虹软科技	367,016.33	3.76
319	601857	中国石油	366,400.00	3.75
320	300102	乾照光电	365,966.00	3.75
321	600699	均胜电子	365,300.00	3.74
322	688320	禾川科技	364,758.13	3.74
323	688603	天承科技	362,667.38	3.71
324	300337	银邦股份	360,754.00	3.69
325	600446	金证股份	360,007.00	3.69
326	600029	南方航空	359,430.00	3.68
327	600596	新安股份	358,870.00	3.68
328	301611	珂玛科技	358,865.00	3.68
329	002043	兔宝宝	358,563.00	3.67
330	300654	世纪天鸿	357,439.00	3.66
331	300075	数字政通	356,657.00	3.65
332	300724	捷佳伟创	356,400.00	3.65

333	002812	恩捷股份	354,389.00	3.63
334	002777	久远银海	353,706.00	3.62
335	601117	中国化学	353,000.00	3.61
336	002841	视源股份	349,868.00	3.58
337	000786	北新建材	349,318.00	3.58
338	603666	亿嘉和	348,916.00	3.57
339	000957	中通客车	347,908.00	3.56
340	600000	浦发银行	347,400.00	3.56
341	000725	京东方A	347,114.00	3.55
342	301231	荣信文化	345,420.00	3.54
343	600141	兴发集团	344,677.00	3.53
344	301236	软通动力	340,842.00	3.49
345	002600	领益智造	340,800.00	3.49
346	301297	富乐德	337,464.00	3.46
347	603662	柯力传感	334,767.00	3.43
348	002396	星网锐捷	331,535.00	3.40
349	300348	长亮科技	330,840.00	3.39
350	603319	美湖股份	329,950.37	3.38
351	300258	精锻科技	327,591.00	3.35
352	002756	永兴材料	326,156.00	3.34
353	688381	帝奥微	323,475.39	3.31
354	603170	宝立食品	321,098.00	3.29
355	688583	思看科技	319,787.60	3.27
356	601952	苏垦农发	318,650.00	3.26
357	300735	光弘科技	315,942.00	3.24
358	603737	三棵树	315,448.00	3.23
359	688573	信宇人	315,271.94	3.23
360	603308	应流股份	312,580.00	3.20
361	600938	中国海油	311,812.00	3.19
362	688502	茂莱光学	311,366.03	3.19
363	301617	博苑股份	309,318.00	3.17

364	300772	运达股份	307,851.00	3.15
365	600845	宝信软件	306,326.00	3.14
366	300339	润和软件	302,500.00	3.10
367	301117	佳缘科技	302,308.00	3.10
368	601012	隆基绿能	300,595.84	3.08
369	600482	中国动力	300,432.00	3.08
370	000988	华工科技	299,063.00	3.06
371	601808	中海油服	292,495.00	3.00
372	688776	国光电气	292,117.93	2.99
373	300037	新宙邦	289,095.00	2.96
374	688472	阿特斯	288,605.03	2.96
375	688602	康鹏科技	284,655.11	2.92
376	688176	亚虹医药	283,114.26	2.90
377	603444	吉比特	282,611.00	2.89
378	600584	长电科技	282,231.00	2.89
379	688443	智翔金泰	281,343.87	2.88
380	603596	伯特利	279,250.00	2.86
381	300666	江丰电子	279,132.00	2.86
382	603063	禾望电气	277,249.00	2.84
383	605168	三人行	277,164.20	2.84
384	002074	国轩高科	275,260.00	2.82
385	600426	华鲁恒升	274,569.00	2.81
386	688518	联赢激光	267,181.41	2.74
387	600867	通化东宝	260,018.00	2.66
388	688155	先惠技术	259,651.82	2.66
389	300634	彩讯股份	259,504.00	2.66
390	300409	道氏技术	255,033.00	2.61
391	601615	明阳智能	251,739.00	2.58
392	688126	沪硅产业	245,675.75	2.52
393	300244	迪安诊断	243,980.00	2.50
394	600298	安琪酵母	243,917.00	2.50

395	688362	甬矽电子	243,459.66	2.49
396	688559	海目星	242,965.37	2.49
397	605088	冠盛股份	241,584.00	2.47
398	688596	正帆科技	240,999.01	2.47
399	601636	旗滨集团	234,970.00	2.41
400	688234	天岳先进	234,118.00	2.40
401	603288	海天味业	233,513.00	2.39
402	300548	长芯博创	225,281.00	2.31
403	688232	新点软件	222,943.89	2.28
404	000400	许继电气	221,553.00	2.27
405	688535	华海诚科	221,218.85	2.27
406	603920	世运电路	220,693.00	2.26
407	300413	芒果超媒	220,436.00	2.26
408	000998	隆平高科	220,240.00	2.26
409	301398	星源卓镁	217,951.00	2.23
410	300068	南都电源	216,930.00	2.22
411	300073	当升科技	216,120.00	2.21
412	300130	新国都	215,813.00	2.21
413	300017	网宿科技	214,559.00	2.20
414	002049	紫光国微	212,818.00	2.18
415	300115	长盈精密	212,814.00	2.18
416	002837	英维克	211,436.00	2.17
417	301291	明阳电气	211,231.00	2.16
418	300918	南山智尚	210,970.00	2.16
419	300827	上能电气	210,120.00	2.15
420	300873	海晨股份	209,937.00	2.15
421	688071	华依科技	209,907.89	2.15
422	688235	百济神州	209,103.46	2.14
423	600577	精达股份	208,009.00	2.13
424	002765	蓝黛科技	207,407.00	2.12
425	000682	东方电子	207,000.00	2.12

426	300748	金力永磁	205,864.00	2.11
427	001282	三联锻造	204,871.00	2.10
428	002913	奥士康	204,632.00	2.10
429	603005	晶方科技	202,479.00	2.07
430	688062	迈威生物	201,176.97	2.06
431	301498	乖宝宠物	200,493.00	2.05
432	688552	航天南湖	200,308.41	2.05
433	603728	鸣志电器	199,564.00	2.04
434	688717	艾罗能源	197,386.34	2.02
435	002273	水晶光电	196,775.00	2.02

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。

#### 8.4.3 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	373,073,416.43
卖出股票收入（成交）总额	375,606,663.79

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。

#### 8.5 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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持有贵金属。

### 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 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。

### 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 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 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。

#### 8.12.2 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。

#### 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	23,376.61
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	52,653.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	76,029.61
---	----	-----------

#### 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

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	688012	中微公司	545,440.00	6.08	停牌

#### 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

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
637	8,508.87	3,692.84	0.07%	5,416,458.83	99.93%

#### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	郑权	200,007.00	20.47%
2	高德荣	120,389.00	12.32%
3	孟勇	118,392.00	12.11%
4	杨凯	66,000.00	6.75%
5	王翔	50,003.00	5.12%
6	李净	48,000.00	4.91%

7	张之垒	35,534.00	3.64%
8	蒋勇	34,000.00	3.48%
9	黄筱若	30,004.00	3.07%
10	黄文胜	22,000.00	2.25%

注：持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员均未持有本基金。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本报告期末本基金的基金经理未持有本基金。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年12月07日)基金份额总额	227,360,148.23
本报告期期初基金份额总额	6,978,471.10
本报告期基金总申购份额	2,262,934.73
减：本报告期基金总赎回份额	3,821,254.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,420,151.67

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，未召开基金份额持有人大会。

## 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

本报告期内，基金管理人聘任郭昊先生为副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 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

本基金本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为7000元人民币，基金管理人支付7000元。目前该会计师事务所已向本基金提供4年的审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	浙江浙商证券资产管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025年11月13日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会浙江监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改
其他	无

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2025年11月13日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会浙江监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改
其他	无

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

## 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	
国泰海通证券	1	73,078,426.98	9.76%	31,854.70	9.76%	-
海通	1	150,023,037.56	20.04%	65,395.70	20.04%	-

证券						
华泰证券	1	81,665,679.80	10.91%	35,598.00	10.91%	-
天风证券	1	195,545,337.34	26.12%	85,237.48	26.12%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	94,687,397.46	12.65%	41,273.15	12.65%	-
华源证券	2	124,636,878.13	16.65%	54,329.54	16.65%	-
开源证券	2	29,043,322.95	3.88%	12,660.48	3.88%	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

注：a)截至报告期末，本公司已在深圳交易所、上海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，本基金新增开源证券56443、015545，天风证券54448和西部证券016273交易单元；退租了国泰海通证券007810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。

### 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
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	503,000.00	100.00%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

本报告期内，本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 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	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2024年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-22
2	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2025-03-15
3	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(2025年第1次重大事项临时更新)	中国证监会规定媒介	2025-03-19
4	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-03-19
5	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(L	中国证监会规定媒介	2025-03-28

	OF)2024年年度报告		
6	浙江浙商证券资产管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-01
7	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(L OF)2025年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
8	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(L OF)2025年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2025-07-19
9	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(L OF)2025年中期报告	中国证监会规定媒介	2025-08-30
10	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(L OF) 溢价风险提示公告	中国证监会规定媒介	2025-10-22
11	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(L OF)2025年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2025-10-28
12	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(L OF)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-11-07
13	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(L OF) 招募说明书(2025年定期更新)	中国证监会规定媒介	2025-11-07
14	浙江浙商证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025-12-18

## §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

本报告期内，浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“公司”)根据《中华人民共和国公司法》《中国证监会关于新(公司法)配套制度规则实施相关过渡期安排》的相关规定，公司2025年第4次股东决定，同意公司不设监事，在董事会中设置由3名独立董事组成的审计委员会，行使相关职权。

## §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。

### 13.2 存放地点

基金管理人住所、托管人住所及深圳证券交易所。

### 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  
二〇二六年三月三十一日