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 年中期报告

2026 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

浙江浙商证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
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 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 55
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 55
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 55
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 55
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 55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 56
7.12 投资组合报告附注 56
§8 基金份额持有人信息 57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 57
8.2 盈利投资者数量占比 57

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 57
8.4 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 57
§9 开放式基金份额变动 58
§10 重大事件揭示 58
10.1 基金份额持有人大会决议 58
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 58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 58
10.4 基金投资策略的改变 58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 59
10.8 其他重大事件 60
§11 影响投资者决策的其他重要信息 61
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 61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 61
§12 备查文件目录 61
12.1 备查文件目录 61
12.2 存放地点 61
12.3 查阅方式 61

§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	5,003,101.08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	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。

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	郭明
	联系电话	0571-87903297	（010）66105799
	电子邮箱	fund@stocke.com.cn	custody@icbc.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	上海证券报

露报纸名称	
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.stocke.com.cn
基金中期报告置备地点	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
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（2026年01月01日- 2026年06月30日）
本期已实现收益	3,931,090.18
本期利润	5,754,979.60
加权平均基金份额本期利润	0.9136
本期加权平均净值利润率	52.70%
本期基金份额净值增长率	66.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年06月30日）
期末可供分配利润	8,756,305.57
期末可供分配基金份额利润	1.7502
期末基金资产净值	13,759,406.65
期末基金份额净值	2.7502
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年06月30日）
基金份额累计净值增长率	175.02%

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

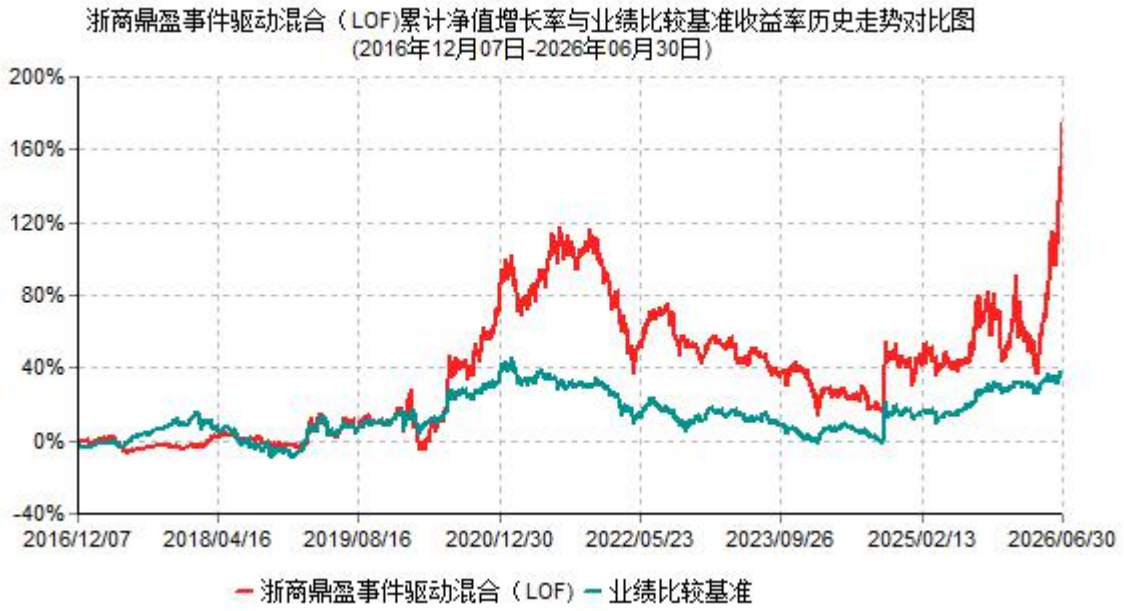
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	100.29%	2.97%	8.45%	0.88%	91.84%	2.09%
过去六个月	66.04%	3.15%	5.59%	0.79%	60.45%	2.36%
过去一年	89.92%	2.73%	17.83%	0.71%	72.09%	2.02%
过去三年	82.98%	1.95%	22.69%	0.77%	60.29%	1.18%
过去五年	34.98%	1.70%	0.53%	0.78%	34.45%	0.92%
过去七年	149.90%	1.68%	26.73%	0.81%	123.17%	0.87%
自基金合同生效起至今	175.02%	1.47%	37.05%	0.81%	137.97%	0.66%

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2026年6月30日，本基金管理人管理浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、浙商汇金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、浙商汇金聚沣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		
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。

4.1.3 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，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

2026年上半年，上证指数上涨3.16%，创业板指上涨35.58%；科创50指数上涨64.25%，成为上半年A股涨幅最高的宽基指数。

上半年A股科技板块经历巨幅波动：一季度在中东冲突、油价上升的宏观背景下，全球通胀预期的抬升和资金风险偏好的下降，带来科技的板块估值的全面下杀；二季度

科技风险偏好全面回归，科创和创业板指数大幅跑赢上证指数，与海外科技股实现全面共振。

本基金上半年持仓主要分布在电子、通信、高端制造等科技相关行业。在全球经济整体偏弱，除AI之外的多数行业数据表现平平的大背景下，科技方向的稀缺性与确定性尤其凸显；优先配置科技方向，正是基于对所处经济周期阶段的研判。

本基金上半年重点把握行业前景、较优业绩且估值相对合理的科技公司作为基金配置的主线，同时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，坚持有明确EPS提升的方向与未来成长空间大的方向相结合，以获得较好的投资回报率和较低的净值波动率。

本基金后续投资运作将继续坚持以科技为核心的持仓，同时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，精选有坚实基本面支撑和强阿尔法的科技标的，在大幅震荡的市场中追求中长期超额回报。

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2.7502元，本报告期内，基金份额净值增长率为66.04%，同期业绩比较基准收益率为5.59%。

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下半年，全球动荡与变革交织演进的趋势愈发鲜明，全球经济复苏在关键路口徘徊，美伊冲突演进、特朗普政策不确定性可能抑制经济增长，AI等新兴技术发展以及潜在的市场风险值得关注。

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。展望下半年，科技成长仍可能是配置主线：首先，AI产业趋势持续上行、政策大力支持未变、美联储难紧缩、国内经济仍偏弱，科技成长仍可能有超额收益；其次，强产业趋势和政策催化使得TMT短期调整可能已较充分。

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。

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。

4.7 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。

4.8 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，本基金于2026年01月01日至2026年06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 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2026年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金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：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,057,134.29	992,867.76
结算备付金		217,740.55	255,799.03
存出保证金		17,397.73	23,376.61
交易性金融资产	6.4.7.2	12,683,936.00	8,003,593.00
其中：股票投资		12,683,936.00	8,003,593.00
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		55,859.37	52,653.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		15,032,067.94	9,328,289.40
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025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		-	-
应付清算款		11.00	-
应付赎回款		867,339.03	104,041.49
应付管理人报酬		11,921.68	9,018.67
应付托管费		1,986.94	1,503.13
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	6.4.7.6	391,402.64	236,172.07
负债合计		1,272,661.29	350,735.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,003,101.08	5,420,151.67

未分配利润	6.4.7.8	8,756,305.57	3,557,402.37
净资产合计		13,759,406.65	8,977,554.04
负债和净资产总计		15,032,067.94	9,328,289.40

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额净值2.7502元，基金份额总额5,003,101.08份。

6.2 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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
一、营业总收入		5,830,644.67	410,865.83
1.利息收入		2,680.66	4,175.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,680.66	3,823.03
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
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,921,497.07	295,127.19
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,916,005.07	277,269.88
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	5,492.00	17,857.31

其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,823,889.42	108,398.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	82,577.52	3,164.43
减：二、营业总支出		75,665.07	68,791.23
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	64,758.02	58,854.78
2.托管费	6.4.10.2.2	10,793.05	9,809.18
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	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	1.27
8.其他费用	6.4.7.20	114.00	126.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,754,979.60	342,074.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,754,979.60	342,074.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,754,979.60	342,074.60

6.3 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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期

	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,420,151.67	3,557,402.37	8,977,554.04
二、本期期初净资产	5,420,151.67	3,557,402.37	8,977,554.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-417,050.59	5,198,903.20	4,781,852.61
（一）、综合收益总额	-	5,754,979.60	5,754,979.60
（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）	-417,050.59	-556,076.40	-973,126.99
其中：1.基金申购款	8,059,835.77	6,488,710.52	14,548,546.29
2.基金赎回款	-8,476,886.36	-7,044,786.92	-15,521,673.28
（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	5,003,101.08	8,756,305.57	13,759,406.65
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30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）	-186,342.38	257,284.94	70,942.56
（一）、综合收益总额	-	342,074.60	342,074.60
（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）	-186,342.38	-84,789.66	-271,132.04
其中：1.基金申购款	369,928.24	168,865.82	538,794.06
2.基金赎回款	-556,270.62	-253,655.48	-809,926.10
（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	6,792,128.72	3,043,824.24	9,835,952.96

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	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

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、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。

6.4.3 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6.4.2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的要求，真实、完整

地反映了本基金2026年6月30日的财务状况、2026年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入, 自2026年1月1日至2027年12月31日，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。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按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) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	2,057,134.29
等于：本金	2,056,971.20
加：应计利息	163.09

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	2,057,134.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		10,886,281.63	-	12,683,936.00	1,797,654.37
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		10,886,281.63	-	12,683,936.00	1,797,654.37

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末，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

本基金在本报告期末，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

本基金在本报告期末，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金在本报告期末，未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	944.78
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	390,457.86
其中：交易所市场	390,457.86
银行间市场	-
应付利息	-
合计	391,402.64

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,420,151.67	5,420,151.67
本期申购	8,059,835.77	8,059,835.77
本期赎回（以“-”号填列）	-8,476,886.36	-8,476,886.36
本期末	5,003,101.08	5,003,101.08

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

6.4.7.8 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	5,551,765.26	-1,994,362.89	3,557,402.37
本期期初	5,551,765.26	-1,994,362.89	3,557,402.37
本期利润	3,931,090.18	1,823,889.42	5,754,979.60
本期基金份额交易产生的变动数	-603,066.59	46,990.19	-556,076.40
其中：基金申购款	8,931,846.80	-2,443,136.28	6,488,710.52
基金赎回款	-9,534,913.39	2,490,126.47	-7,044,786.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,879,788.85	-123,483.28	8,756,305.57

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	2,284.51
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	362.18
其他	33.97
合计	2,680.66

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	181,149,762.92

减：卖出股票成本总额	176,962,694.09
减：交易费用	271,063.76
买卖股票差价收入	3,916,005.07

6.4.7.11 基金投资收益

本基金在本报告期内，未进行基金投资。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金在本报告期内，未持有债券。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内，未持有资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内，未持有贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内，未持有衍生工具。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内，未持有其他衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,492.00
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	5,492.00

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	1,823,889.42
——股票投资	1,823,889.42
——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	1,823,889.42

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	82,577.52
合计	82,577.52

6.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期内，未产生信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	-
信息披露费	-

证券出借违约金	-
汇划手续费	114.00
合计	114.00

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、关联关系

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

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化，以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9.2 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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金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股票交易。

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

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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间内，无应支付关联方的佣金。

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 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	64,758.02	58,854.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	28,349.80	27,951.04
应支付基金管理人的净管理费	36,408.22	30,903.74

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×1.20%÷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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026	上年度可比期间 2025年01月01日至2025

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,793.05	9,809.18

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×0.2%÷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。

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。

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。

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

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。

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

本基金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。

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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
中国工商银行股份有限公司	2,057,134.29	2,284.51	2,027,902.94	3,465.65

注：本基金的银行存款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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未在承销期内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2026年6月30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。

6.4.11 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。

6.4.12 期末（2026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

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2026年06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2026年06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

本基金在本报告期末，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。

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。

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，以及审计委员会的监督检查；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。

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 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2026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							
货币资金	2,057,134.29	-	-	-	-	-	2,057,134.29
结算备付金	217,740.55	-	-	-	-	-	217,740.55
存出保证金	17,397.73	-	-	-	-	-	17,397.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	12,683,936.00	12,683,936.00
应收申购款	-	-	-	-	-	55,859.37	55,859.37
资产总计	2,292,272.57	-	-	-	-	12,739,795.37	15,032,067.94
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	11.00	11.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	867,339.03	867,339.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,921.68	11,921.68
应付托管费	-	-	-	-	-	1,986.94	1,986.94

其他负债	-	-	-	-	-	391,402.64	391,402.64
负债总计	-	-	-	-	-	1,272,661.29	1,272,661.29
利率敏感度缺口	2,292,272.57	-	-	-	-	11,467,134.08	13,759,406.65
上年度末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

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。

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 2026年06月30日		上年度末 2025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	12,683,936.00	92.18	8,003,593.00	89.15
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	12,683,936.00	92.18	8,003,593.00	89.15

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1、沪深300指数上涨5%	1,134,099.77	795,256.03
	2、沪深300指数下跌5%	-1,134,099.77	-795,256.03

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	风险价值	-699,559.48	-400,899.00
	合计	-699,559.48	-400,899.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	12,683,936.00	7,458,153.00
第二层次	-	545,440.00
第三层次	-	-
合计	12,683,936.00	8,003,593.00

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至于本报告期末，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。

§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	12,683,936.00	84.38
	其中：股票	12,683,936.00	84.38
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	2,274,874.84	15.13
8	其他各项资产	73,257.10	0.49
9	合计	15,032,067.94	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,679,452.00	77.62
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	2,004,484.00	14.57
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	12,683,936.00	92.18

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	603986	兆易创新	1,200	978,000.00	7.11
2	300223	北京君正	3,600	896,040.00	6.51
3	688521	芯原股份	2,000	742,280.00	5.39
4	688120	华海清科	2,000	644,360.00	4.68
5	688233	神工股份	3,000	643,260.00	4.68
6	688256	寒武纪	400	638,220.00	4.64
7	688548	广钢气体	12,000	625,200.00	4.54
8	688702	盛科通信	1,600	623,984.00	4.53
9	688766	普冉股份	800	613,280.00	4.46
10	300666	江丰电子	1,600	589,760.00	4.29

11	688498	源杰科技	300	565,800.00	4.11
12	688012	中微公司	1,200	562,200.00	4.09
13	688347	华虹宏力	1,600	538,080.00	3.91
14	688200	华峰测控	1,000	525,100.00	3.82
15	688082	盛美上海	1,200	518,400.00	3.77
16	688361	中科飞测	1,200	516,000.00	3.75
17	300604	长川科技	1,500	512,130.00	3.72
18	688809	强一股份	800	498,400.00	3.62
19	688981	中芯国际	3,000	476,460.00	3.46
20	688610	埃科光电	1,800	474,120.00	3.45
21	301611	珂玛科技	2,600	468,182.00	3.40
22	600183	生益科技	200	34,680.00	0.25

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	300502	新易盛	5,393,002.00	60.07
2	300308	中际旭创	4,178,393.00	46.54
3	688981	中芯国际	4,144,983.50	46.17
4	688521	芯原股份	3,835,317.99	42.72
5	688256	寒武纪	3,701,328.55	41.23
6	688498	源杰科技	3,520,594.19	39.22
7	603986	兆易创新	3,506,858.00	39.06
8	300666	江丰电子	3,343,627.00	37.24
9	688012	中微公司	3,190,550.40	35.54
10	688347	华虹宏力	2,789,605.98	31.07
11	300223	北京君正	2,765,790.00	30.81
12	688041	海光信息	2,731,249.19	30.42

13	688525	佰维存储	2,662,304.05	29.66
14	688072	拓荆科技	2,584,762.96	28.79
15	688120	华海清科	2,199,079.02	24.50
16	300661	圣邦股份	2,119,495.00	23.61
17	601869	长飞光纤	2,038,371.00	22.71
18	300454	深信服	1,993,517.00	22.21
19	688766	普冉股份	1,883,816.65	20.98
20	600522	中天科技	1,880,877.00	20.95
21	301308	江波龙	1,846,663.00	20.57
22	688019	安集科技	1,812,856.45	20.19
23	600487	亨通光电	1,764,171.00	19.65
24	001309	德明利	1,690,546.00	18.83
25	002384	东山精密	1,652,631.00	18.41
26	688375	国博电子	1,614,123.14	17.98
27	688548	广钢气体	1,497,793.24	16.68
28	300475	香农芯创	1,484,206.12	16.53
29	600879	航天电子	1,445,675.00	16.10
30	300136	信维通信	1,399,442.87	15.59
31	301611	珂玛科技	1,394,941.00	15.54
32	688652	京仪装备	1,379,261.37	15.36
33	300672	国科微	1,364,253.00	15.20
34	688082	盛美上海	1,351,754.36	15.06
35	002371	北方华创	1,339,454.00	14.92
36	688691	灿芯股份	1,311,718.26	14.61
37	688037	芯源微	1,221,409.39	13.61
38	688008	澜起科技	1,164,156.07	12.97
39	600183	生益科技	1,153,112.96	12.84
40	300433	蓝思科技	1,152,861.00	12.84
41	301511	德福科技	1,129,925.00	12.59
42	600498	烽火通信	1,109,767.00	12.36
43	688536	思瑞浦	1,080,650.66	12.04

44	600118	中国卫星	1,076,571.00	11.99
45	301005	超捷股份	1,076,442.00	11.99
46	688702	盛科通信	1,067,638.04	11.89
47	301217	铜冠铜箔	1,046,835.00	11.66
48	605090	九丰能源	1,042,389.00	11.61
49	688048	长光华芯	1,038,330.49	11.57
50	600584	长电科技	1,027,986.00	11.45
51	002281	光迅科技	1,026,753.00	11.44
52	605598	上海港湾	1,004,198.00	11.19
53	603698	航天工程	1,004,046.00	11.18
54	002565	顺灏股份	1,001,030.00	11.15
55	605358	立昂微	975,728.00	10.87
56	300604	长川科技	950,241.05	10.58
57	300236	上海新阳	915,152.00	10.19
58	600105	永鼎股份	895,529.00	9.98
59	688630	芯碁微装	883,796.11	9.84
60	300762	上海瀚讯	872,680.00	9.72
61	688777	中控技术	872,191.04	9.72
62	688808	联讯仪器	869,005.18	9.68
63	688361	中科飞测	862,326.43	9.61
64	300751	迈为股份	832,851.00	9.28
65	002294	信立泰	823,702.00	9.18
66	688615	合合信息	818,849.56	9.12
67	002653	海思科	818,618.00	9.12
68	688387	信科移动	817,846.54	9.11
69	600176	中国巨石	809,637.00	9.02
70	002080	中材科技	807,484.00	8.99
71	688486	龙迅股份	802,321.41	8.94
72	688610	埃科光电	796,452.25	8.87
73	300785	值得买	774,358.00	8.63
74	688200	华峰测控	771,221.20	8.59

75	600343	航天动力	761,397.00	8.48
76	688233	神工股份	754,825.36	8.41
77	601698	中国卫通	748,046.00	8.33
78	688385	复旦微电	744,071.57	8.29
79	603596	伯特利	739,289.20	8.23
80	688052	纳芯微	737,735.28	8.22
81	603259	药明康德	736,501.00	8.20
82	688147	微导纳米	733,149.78	8.17
83	300476	胜宏科技	723,076.00	8.05
84	301232	飞沃科技	719,174.00	8.01
85	688409	富创精密	710,181.22	7.91
86	688249	晶合集成	706,419.44	7.87
87	688126	沪硅产业	704,975.65	7.85
88	603061	金海通	696,222.00	7.76
89	002149	西部材料	681,779.00	7.59
90	603186	华正新材	678,257.00	7.56
91	300102	乾照光电	675,912.00	7.53
92	300394	天孚通信	673,100.00	7.50
93	300364	中文在线	669,518.00	7.46
94	300446	航天智造	667,945.00	7.44
95	300054	鼎龙股份	667,724.00	7.44
96	002230	科大讯飞	646,051.00	7.20
97	603601	再升科技	643,532.00	7.17
98	603256	宏和科技	636,270.00	7.09
99	300975	商络电子	629,629.00	7.01
100	300337	银邦股份	623,066.00	6.94
101	688311	盟升电子	620,356.59	6.91
102	301536	星宸科技	618,943.00	6.89
103	300342	天银机电	616,613.00	6.87
104	688205	德科立	599,769.02	6.68
105	688111	金山办公	556,525.96	6.20

106	603083	剑桥科技	542,822.00	6.05
107	688172	燕东微	520,777.25	5.80
108	688809	强一股份	498,792.00	5.56
109	603618	杭电股份	495,699.00	5.52
110	002129	TCL中环	493,403.00	5.50
111	688692	达梦数据	488,427.74	5.44
112	002636	金安国纪	487,573.00	5.43
113	688359	三孚新科	487,526.62	5.43
114	688625	呈和科技	477,312.25	5.32
115	688584	上海合晶	464,271.83	5.17
116	301526	国际复材	462,414.00	5.15
117	603127	昭衍新药	452,282.00	5.04
118	603011	合锻智能	449,332.00	5.01
119	688668	鼎通科技	448,756.84	5.00
120	002222	福晶科技	443,874.00	4.94
121	688106	金宏气体	443,028.32	4.93
122	301486	致尚科技	438,086.00	4.88
123	688382	益方生物	435,839.93	4.85
124	301093	华兰股份	433,148.00	4.82
125	002552	宝鼎科技	433,010.00	4.82
126	603929	亚翔集成	432,492.00	4.82
127	688331	荣昌生物	429,217.05	4.78
128	300757	罗博特科	427,841.00	4.77
129	688820	盛合晶微	425,472.14	4.74
130	002920	德赛西威	423,904.00	4.72
131	601208	东材科技	423,000.00	4.71
132	301205	联特科技	421,931.00	4.70
133	600500	中化国际	418,148.00	4.66
134	301099	雅创电子	417,501.00	4.65
135	688515	裕太微	416,274.53	4.64
136	605128	上海沿浦	416,024.00	4.63

137	301377	鼎泰高科	415,527.00	4.63
138	688300	联瑞新材	412,350.91	4.59
139	000657	中钨高新	412,092.00	4.59
140	688135	利扬芯片	411,559.87	4.58
141	688818	电科蓝天	410,744.15	4.58
142	688368	晶丰明源	408,498.60	4.55
143	688313	仕佳光子	404,444.64	4.51
144	605589	圣泉集团	404,292.00	4.50
145	301373	凌玮科技	402,970.00	4.49
146	600160	巨化股份	388,371.00	4.33
147	002465	海格通信	386,686.00	4.31
148	301382	蜂助手	380,673.00	4.24
149	301421	波长光电	377,547.00	4.21
150	300455	航天智装	375,206.00	4.18
151	688539	高华科技	373,318.92	4.16
152	000963	华东医药	370,160.00	4.12
153	688605	先锋精科	368,822.10	4.11
154	603031	安孚科技	366,335.00	4.08
155	600761	安徽合力	363,408.00	4.05
156	688636	智明达	361,556.83	4.03
157	300450	先导智能	360,911.00	4.02
158	301171	易点天下	359,894.00	4.01
159	301306	西测测试	357,337.00	3.98
160	600096	云天化	356,206.00	3.97
161	600276	恒瑞医药	353,903.00	3.94
162	300623	捷捷微电	351,605.00	3.92
163	600990	四创电子	349,074.00	3.89
164	688626	翔宇医疗	348,432.00	3.88
165	300900	广联航空	346,536.00	3.86
166	600141	兴发集团	343,682.00	3.83
167	688002	睿创微纳	343,084.67	3.82

168	300760	迈瑞医疗	342,862.00	3.82
169	300418	昆仑万维	338,844.00	3.77
170	688271	联影医疗	335,486.53	3.74
171	002025	航天电器	333,754.00	3.72
172	688596	正帆科技	332,934.66	3.71
173	300037	新宙邦	329,124.00	3.67
174	600151	航天机电	328,980.00	3.66
175	002422	科伦药业	326,425.00	3.64
176	002202	金风科技	322,553.00	3.59
177	002601	龙佰集团	322,455.00	3.59
178	301662	宏工科技	317,831.00	3.54
179	600460	士兰微	313,333.00	3.49
180	600143	金发科技	311,200.00	3.47
181	300759	康龙化成	308,946.00	3.44
182	002709	天赐材料	306,747.00	3.42
183	600549	厦门钨业	306,553.00	3.41
184	600309	万华化学	303,565.00	3.38
185	600378	昊华科技	302,918.00	3.37
186	603893	瑞芯微	302,845.00	3.37
187	688568	中科星图	302,095.41	3.37
188	600426	华鲁恒升	301,615.00	3.36
189	688627	精智达	296,932.48	3.31
190	300458	全志科技	296,128.00	3.30
191	688066	*ST航图	292,554.88	3.26
192	300652	雷迪克	285,055.00	3.18
193	688416	恒烁股份	283,975.56	3.16
194	688102	斯瑞新材	283,407.88	3.16
195	688508	芯朋微	281,064.65	3.13
196	002046	国机精工	278,137.00	3.10
197	002792	通宇通讯	277,245.00	3.09
198	002605	姚记科技	264,015.00	2.94

199	002739	儒意电影	261,780.00	2.92
200	688268	华特气体	260,447.37	2.90
201	688099	晶晨股份	234,242.21	2.61
202	300409	道氏技术	232,030.00	2.58
203	688608	恒玄科技	202,731.25	2.26
204	301392	汇成真空	192,436.00	2.14
205	300567	精测电子	192,430.00	2.14
206	688018	乐鑫科技	181,000.00	2.02

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	300502	新易盛	5,657,545.00	63.02
2	300308	中际旭创	4,306,850.00	47.97
3	688981	中芯国际	4,201,264.51	46.80
4	688256	寒武纪	3,718,532.27	41.42
5	688498	源杰科技	3,671,151.62	40.89
6	688012	中微公司	3,537,506.65	39.40
7	300666	江丰电子	3,424,182.71	38.14
8	688521	芯原股份	3,229,869.86	35.98
9	688041	海光信息	3,222,619.42	35.90
10	688072	拓荆科技	3,087,734.60	34.39
11	688347	华虹宏力	2,950,478.79	32.87
12	688525	佰维存储	2,937,503.61	32.72
13	603986	兆易创新	2,761,752.00	30.76
14	300661	圣邦股份	2,135,543.00	23.79

15	601869	长飞光纤	2,100,836.00	23.40
16	688375	国博电子	2,060,840.71	22.96
17	300223	北京君正	1,985,841.00	22.12
18	300454	深信服	1,948,651.00	21.71
19	688120	华海清科	1,940,165.73	21.61
20	600487	亨通光电	1,932,797.00	21.53
21	600522	中天科技	1,926,580.00	21.46
22	688019	安集科技	1,913,314.08	21.31
23	001309	德明利	1,872,578.00	20.86
24	301308	江波龙	1,839,410.00	20.49
25	002371	北方华创	1,783,448.00	19.87
26	688652	京仪装备	1,738,373.40	19.36
27	002384	东山精密	1,581,621.00	17.62
28	300475	香农芯创	1,470,067.00	16.37
29	301611	珂玛科技	1,452,875.00	16.18
30	600879	航天电子	1,435,514.00	15.99
31	688037	芯源微	1,406,457.61	15.67
32	300136	信维通信	1,365,771.00	15.21
33	301217	铜冠铜箔	1,347,558.00	15.01
34	600183	生益科技	1,340,727.00	14.93
35	688766	普冉股份	1,318,154.18	14.68
36	300433	蓝思科技	1,309,643.00	14.59
37	688691	灿芯股份	1,305,511.68	14.54
38	300672	国科微	1,279,903.00	14.26
39	688048	长光华芯	1,258,807.96	14.02
40	301511	德福科技	1,240,106.00	13.81
41	688536	思瑞浦	1,165,997.67	12.99
42	688147	微导纳米	1,164,342.91	12.97
43	688385	复旦微电	1,162,298.58	12.95
44	600176	中国巨石	1,159,125.00	12.91
45	688008	澜起科技	1,139,523.43	12.69

46	688548	广钢气体	1,117,593.04	12.45
47	301005	超捷股份	1,101,838.00	12.27
48	600498	烽火通信	1,070,891.00	11.93
49	600584	长电科技	1,034,644.00	11.52
50	688361	中科飞测	1,024,303.74	11.41
51	600118	中国卫星	1,011,037.00	11.26
52	688702	盛科通信	1,003,845.63	11.18
53	300236	上海新阳	991,020.00	11.04
54	603698	航天工程	978,332.00	10.90
55	002565	顺灏股份	974,006.00	10.85
56	600105	永鼎股份	956,222.00	10.65
57	688082	盛美上海	944,630.38	10.52
58	605358	立昂微	944,307.08	10.52
59	605598	上海港湾	943,981.00	10.51
60	002281	光迅科技	917,826.00	10.22
61	688630	芯碁微装	915,072.06	10.19
62	605090	九丰能源	909,178.00	10.13
63	300604	长川科技	908,482.00	10.12
64	002080	中材科技	900,435.00	10.03
65	688808	联讯仪器	883,952.00	9.85
66	688777	中控技术	870,755.25	9.70
67	002653	海思科	828,534.00	9.23
68	300751	迈为股份	814,851.00	9.08
69	002294	信立泰	813,486.00	9.06
70	688409	富创精密	804,952.83	8.97
71	688126	沪硅产业	804,884.80	8.97
72	300762	上海瀚讯	794,725.00	8.85
73	688486	龙迅股份	793,577.76	8.84
74	688052	纳芯微	787,997.44	8.78
75	688615	合合信息	787,714.57	8.77
76	603259	药明康德	772,271.00	8.60

77	300785	值得买	765,417.00	8.53
78	301232	飞沃科技	758,805.00	8.45
79	688387	信科移动	755,618.38	8.42
80	600343	航天动力	750,654.00	8.36
81	603061	金海通	748,194.75	8.33
82	688002	睿创微纳	742,787.05	8.27
83	603596	伯特利	739,689.52	8.24
84	300476	胜宏科技	738,587.00	8.23
85	300102	乾照光电	736,201.00	8.20
86	688249	晶合集成	704,234.37	7.84
87	300342	天银机电	703,770.00	7.84
88	601698	中国卫通	686,908.00	7.65
89	300054	鼎龙股份	674,913.00	7.52
90	002230	科大讯飞	663,075.00	7.39
91	603256	宏和科技	662,303.00	7.38
92	002149	西部材料	659,765.00	7.35
93	300975	商络电子	645,630.00	7.19
94	300364	中文在线	641,474.00	7.15
95	301536	星宸科技	623,465.00	6.94
96	300446	航天智造	622,862.00	6.94
97	300567	精测电子	598,555.00	6.67
98	300394	天孚通信	596,881.00	6.65
99	603601	再升科技	593,670.00	6.61
100	002636	金安国纪	585,196.00	6.52
101	603186	华正新材	584,581.00	6.51
102	688311	盟升电子	574,131.43	6.40
103	688172	燕东微	562,559.13	6.27
104	688820	盛合晶微	560,563.05	6.24
105	688205	德科立	552,213.08	6.15
106	301526	国际复材	547,736.00	6.10
107	300337	银邦股份	543,514.00	6.05

108	000657	中钨高新	529,927.00	5.90
109	688111	金山办公	526,172.44	5.86
110	688668	鼎通科技	519,621.28	5.79
111	688610	埃科光电	501,605.18	5.59
112	002129	TCL中环	497,919.00	5.55
113	603083	剑桥科技	487,611.00	5.43
114	688359	三孚新科	476,494.17	5.31
115	603618	杭电股份	473,327.00	5.27
116	603127	昭衍新药	459,877.00	5.12
117	301093	华兰股份	455,290.00	5.07
118	688584	上海合晶	452,683.58	5.04
119	688625	呈和科技	450,282.54	5.02
120	688300	联瑞新材	447,612.68	4.99
121	002552	宝鼎科技	443,553.00	4.94
122	301099	雅创电子	438,876.00	4.89
123	688692	达梦数据	438,449.71	4.88
124	601208	东材科技	436,567.00	4.86
125	301377	鼎泰高科	434,902.00	4.84
126	688818	电科蓝天	428,249.88	4.77
127	301382	蜂助手	428,159.00	4.77
128	688331	荣昌生物	427,293.23	4.76
129	603929	亚翔集成	425,954.00	4.74
130	688382	益方生物	422,905.47	4.71
131	603011	合锻智能	420,203.00	4.68
132	688368	晶丰明源	419,284.64	4.67
133	300757	罗博特科	418,337.00	4.66
134	688135	利扬芯片	417,645.85	4.65
135	002222	福晶科技	416,221.00	4.64
136	002920	德赛西威	412,652.00	4.60
137	688515	裕太微	407,273.53	4.54
138	605128	上海沿浦	400,462.00	4.46

139	301373	凌玮科技	391,156.00	4.36
140	688106	金宏气体	389,457.97	4.34
141	605589	圣泉集团	387,750.00	4.32
142	301205	联特科技	383,700.00	4.27
143	600160	巨化股份	380,071.00	4.23
144	688636	智明达	379,886.03	4.23
145	688313	仕佳光子	375,939.34	4.19
146	600500	中化国际	373,579.00	4.16
147	300450	先导智能	365,777.00	4.07
148	600096	云天化	365,672.00	4.07
149	300418	昆仑万维	361,459.00	4.03
150	688392	骄成超声	360,895.50	4.02
151	000963	华东医药	357,978.00	3.99
152	600761	安徽合力	356,503.00	3.97
153	688605	先锋精科	356,202.35	3.97
154	301486	致尚科技	351,376.00	3.91
155	600276	恒瑞医药	350,357.00	3.90
156	301171	易点天下	348,482.80	3.88
157	300455	航天智装	348,258.00	3.88
158	300623	捷捷微电	344,107.00	3.83
159	688596	正帆科技	337,698.85	3.76
160	300760	迈瑞医疗	337,108.00	3.76
161	002601	龙佰集团	335,223.00	3.73
162	300037	新宙邦	334,253.00	3.72
163	603031	安孚科技	331,216.00	3.69
164	688271	联影医疗	331,097.58	3.69
165	600143	金发科技	321,951.00	3.59
166	603893	瑞芯微	319,867.00	3.56
167	688626	翔宇医疗	319,496.51	3.56
168	688200	华峰测控	319,188.53	3.56
169	301306	西测测试	319,014.00	3.55

170	002422	科伦药业	318,555.00	3.55
171	002465	海格通信	316,982.00	3.53
172	688539	高华科技	315,723.95	3.52
173	600549	厦门钨业	312,099.00	3.48
174	688233	神工股份	310,659.88	3.46
175	301662	宏工科技	309,834.00	3.45
176	002202	金风科技	307,282.00	3.42
177	002709	天赐材料	306,976.00	3.42
178	600378	昊华科技	306,493.00	3.41
179	600151	航天机电	306,060.00	3.41
180	600309	万华化学	305,753.00	3.41
181	688416	恒烁股份	304,967.66	3.40
182	600141	兴发集团	304,023.00	3.39
183	300759	康龙化成	302,600.00	3.37
184	002025	航天电器	302,067.00	3.36
185	301421	波长光电	296,972.00	3.31
186	600426	华鲁恒升	296,516.00	3.30
187	002792	通宇通讯	296,328.00	3.30
188	300458	全志科技	294,083.00	3.28
189	600990	四创电子	292,906.00	3.26
190	600460	士兰微	290,005.00	3.23
191	300900	广联航空	287,940.00	3.21
192	002046	国机精工	270,921.00	3.02
193	688268	华特气体	267,267.59	2.98
194	688568	中科星图	266,636.08	2.97
195	002605	姚记科技	266,050.00	2.96
196	300409	道氏技术	265,502.00	2.96
197	300652	雷迪克	260,123.00	2.90
198	688102	斯瑞新材	259,277.06	2.89
199	688627	精智达	257,922.00	2.87
200	688508	芯朋微	253,679.63	2.83

201	002739	儒意电影	247,037.51	2.75
202	688099	晶晨股份	230,239.00	2.56
203	688066	*ST航图	201,593.42	2.25
204	688608	恒玄科技	184,905.00	2.06
205	688018	乐鑫科技	182,070.00	2.03
206	301392	汇成真空	180,024.00	2.01

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	179,819,147.67
卖出股票收入（成交）总额	181,149,762.92

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持有贵金属。

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 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 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，没有超出基金合同约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	17,397.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	55,859.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,257.10

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

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
848	5,899.88	867.00	0.02%	5,002,234.08	99.98%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	77.49%

8.3 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。

8.4 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。

§9 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	5,420,151.67
本报告期基金总申购份额	8,059,835.77
减：本报告期基金总赎回份额	8,476,886.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,003,101.08

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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人及高级管理人员未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 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。

10.6.4 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。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	116,500,394.30	32.27%	50,783.28	32.27%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	40,960,486.26	11.35%	17,854.83	11.35%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	48,630,751.21	13.47%	21,197.61	13.47%	-
国海证券	2	34,688,911.23	9.61%	15,121.22	9.61%	-
华安证券	2	37,794,386.49	10.47%	16,474.43	10.47%	-
华源	2	37,146,486.95	10.29%	16,192.26	10.29%	-

证券						
开源证券	2	22,320,144.39	6.18%	9,729.02	6.18%	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	22,927,349.76	6.35%	9,993.98	6.35%	-

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。本基金深交所退租国泰海通证券席位，租用中信证券、国海证券、华安证券、中信证券席位；上交所租用中信证券、国海证券、华安证券、中信证券席位。

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

c)基金交易单元的选择程序如下：

1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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。

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	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	浙商汇金鼎盈事件驱动灵活	中国证监会规定媒介	2026-03-31

	配置混合型证券投资基金(LOF)2025年年度报告		
3	浙江浙商证券资产管理有限公司关于在直销柜台开展基金认购、申购和转换费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-02
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)2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-15
5	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金风险等级调整的通知	中国证监会规定媒介	2026-06-30

§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。

12.2 存放地点

基金管理人住所、托管人住所及深圳证券交易所。

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

二〇二六年八月二十九日