8.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

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

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

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

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部

文案调查,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

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

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

由于四舍五人的原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和

持有份 占总份 持有份 額 額比例 額

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间

注: 本报告期末, 本基金管理人的高级管理人员, 基金投资及研究部

№ 10 开放式基金份额变动

《11 重大事件揭示

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

基金管理人的重大人事变动:2018年5月,浙江浙商证券资产管理

有限公司的董事长由吴承根先生变更为盛建龙先生;2018年7月,浙江 浙商证券资产管理有限公司的副总经理楼小平先生代为履行总经理职 务;2018年11月,浙江浙商证券资产管理有限公司的聘任路迹女士担任

国总经理研究。上述八事支列,为CIX相关规定目录、公司。 基金托管人的重大人事变动;2018年5月,中国光大银行股份有限 公司聘任张博先生担任投资与托管业务部总经理职务;2018年11月,中

国光大银行股份有限公司聘任葛海蛟先生担任中国光大银行股份有限

副总经理职务。上述人事变动,均已按相关规定备案,公告

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

与合计项之间可能存在尾差。

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

木其全木报告期未进行贵全屋投资

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有股票。

本公司高级管理人员、基金投资和 7.6.表人持有木环放式基金

门负责人均未持有本基金。

基金合同生效日起至报告期期末基金息 由數份經

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

主体未受到公开谴责、处罚。

本报告期内,本基金未参与国债期货交易。

允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资

金额单位:人民币元

公允价值 占基金资产》 比例(%)

公允价值 占基金资产产 例(%)

单位:人民币元

份额单位:份

51.79

单位:份

本基金本报告期内无股票交易 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

支持证券投资明细

投资明细



## **浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金** 2018年年度报告摘要

基金管理人:浙江浙商证券资产管理有限公司 基金托管人:中国光大银行股份有限公司 送出日期:2019年03月28日

《1 重要提示

基金管理人誘江浙南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,误导性解述或重大遗漏,并对其内容的真实性、推确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经过全路董事签字回家,并由董事长签号。 3光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月27日复核了本报告中的》 投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记截,误导性除述或者重大遗漏。 6产管理有限公司或诺以诚实信用,勤助尽害的原则管理和区用基金资产。但不保证基 2列。 是全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的8. 5及其更新。 1/65/天平 北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务出具了无保留意见的审计报告。 本年度报告攝要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。 本报告期自2018年8月6日(基金合同生效日)起至12月31日 ir

§ 2 基金简介

芒期开放式 月06日			
月06日			
浙江浙商证券资产管理有限公司			
中国光大银行股份有限公司			
280,020,032.95(1)			
不定期			
聚禄一年定期A	浙商汇金聚禄一年定期C		
	005424		
509.23 <del>(/)</del>	65,998,523.72 <del>(/)</del>		
	•		
本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上,力求获 得高于业绩比较基准的投资收益。			
-	风险和追求基金    在的投资收益。		

一)封闭期投资策略包含1、资产配置策略;2、债券投资组合、债券投资策略;4、国债期货投资策略;(二)开放期投资策略 开放期内、本基金为保持整富的组合海动性:方值和岛 k # 遵守 本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高 的均资品种。

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金 2.3 基金管理人和基金托管人

5户服务电记

2.5 其他相关资料

3.2 基金净值表现

浙商汇金聚禄一年定期A

浙商汇金聚禄一年定期C

期业绩比较基准收益率变动的比较

仓。

仓。

主要财务指标,基金净值表现及利润分配情况

主:1、本基金合同于2018年8月6日起生效,自合同生效日起至本报

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计 入费用后实际收益水平要低于所列数字。 3、本期已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(不包含

公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、期末可供分配利润,为期末资产负债表中分配利润与未分配利润

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

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

注: 本基金自合同生效日2018年8月6日起至报告期末尚未完成建

(I)-(3)

份額净值 增长率示 准差② 业绩比较基 收益率标准差 ①

份额净值 增长率① 增长率标 准整② 加收益率③ 收號比较基准 ④

数据和指标按实际存续期计算,不按整个自然在度计算

数据和指标按实际存续期计算,不按整个自然年度计算。

木基全自2018年8月6日(基全会同生效日)至2018年12月31日 相

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

所等成分。2013年10月10日 - 10月10日 - 1

750.16年並为660年2月1日,2018年2月2日,1978年2月1日,1978年2月2日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月1日,1978年2月,197

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 ,浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇

证转型成长指数型证券投资基金、浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证

券投资基金和浙商汇金短债债券型证券投资基金。 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位:人民币元 由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

金在本报告期内未达到基金分面的标准,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

, 本报告期内,本基金未发生《公开募集证券投资基金运行管理办

法》的第四十一条所述情形。 § 5 托管人报告

开放债券型证券投资基金(以下称"本基金")托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金 信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定、依 信念成聯語主導力為《及學院公开法》、基立自門式是的於今時, 法安全保管了基金的全部资产,对本基金的投资运作进行了全面的会计 核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定 如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告、没有发生任何损 害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金 托管人所应尽的义务。 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润

分配等情况的说明 本报告期内,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、

《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息按露管理办法》及 其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人的投资运

表意见 中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《浙商汇金中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《浙商汇金史》 认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告 中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报 告等内容直实、准确。

有限公司浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金2018年12月 引用的资产负债表,2018年度的利润表,所有者权益焦金净值,空对表 以及财务报表附注出具了标准无保留意见 ([2019] 京会兴审字第 04030071号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全

67 年度财务报表 7.1 资产负债表

会计主体:浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金 报告截止日:2018年12月31日



§ 4 管理人报告 4.1 基金管理人及基金经理情况 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验 浙江浙商证券资产管理有限公司成立于2013年4月18日,是原浙商证券有限责任公司设立的全资子公司。公司经中国证券监督管理委员会 《关于核准协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,由浙商证券有限责任公司出资5亿元 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

> 新净值1 0337元 其全份新总额214 021 509 23份·浙商汇全聚禄一年 定期C基金份额净值1.0321元,基金份额总额65,998,523.72份。

会计主体:浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金

	7-12
項目	本期2018年08月06日(基金合同生效日)至2018年12
一、收入	12,
1.利息收入	7,
其中:存款利息收入	
债券利息收人	6,
资产支持证券利息收入	
买人返售金融资产收人	
其他利息收人	
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,
其中:股票投资收益	
基金投资收益	
债券投资收益	

并公告披露之日。证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管 理办法》的相关规定 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期內严格遵守《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,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 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

和的扩大人员接到100万亿亿百万公司日本还是工程。 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

选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 日券的每笔交易根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 13.2 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

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

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

2018年债券市场经历了由熊转牛的迅速切换。海外,中美贸易摩擦 事件贯穿了全年的投资逻辑。国内,资管新规、银行开型所领等影响 2017年市场的强监管落地后,监管利空因紊基本出尽。随着基本面走 弱,投资者风险偏好下行,货币政策先行,全年多次降准,各期限债券收 益率下行近100BP。

报告期内,本基金增加了中高等级中长久期债券配置,回撤控制在 较小范围,控制了组合久期,适度提高了组合杠杆。感谢投资者的支持, 我们将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金,努力为持有人获取 优异回报。

442 报告期内基金的业绩表现

44.2 报告期内基金的业绩表现 截至报告期末浙商汇金聚禄一年定期A基金份额净值为1.0337元, 本报告期内,该类基金份额净值增长率为3.37%,同期业绩比较基准收 益率为1.55%;截至报告期末浙商汇金聚禄一年定期C基金份额净值为 1.0321元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为3.21%,同期业绩比 较基准收益率为1.55%。 新生化工学/120%。 45. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望2019年,政府工作强调了宏观政策逆周期调节力度。预计上半

年将密集出台相关政策,财政政策与货币政策同时发力。 汇率企稳给国内货币政策更多的空间,海外因素对国内利率下行制约消退。 油价及猪价下行,通缩风险替代通胀忧虑。 经济基本面下行压力仍较大、但市场对 宽货市反应较充分,利率快速下行后,后续可能会以震荡为主。信用债投资较确定,高等级债券中长久期投资仍是较优策略。 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定及我 司估值政策和程序,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人 

估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估 值和定价因素的基础上,确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管 理人的估值人员均具有专业会计学习经历,具有基金从业人员资格。 本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。 本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,

根据相关法律法规及基金合同的要求以及基金实际运作情况,本基

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 本报告期内,中国光大银行股份有限公司在浙商汇金聚禄一年定期

作、信息披露等行为讲行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作 基金资产单值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关 法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情 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

北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)对浙江浙商证券资产管理

E / <sup>06</sup> 1	
尺行存款	10,164,788.43
5算备付金	2,564,196.69
出保证金	27,803.58
5易性金融资产	464,103,466.77
中:股票投资	_
<b>「金投资</b>	
<b>等投资</b>	423,908,018.00
行产支持证券投资	40,195,448.77
f金属投资	_
<b>5生金融资产</b>	_
[人返售金融资产	30,010,135.02
2收证券清算款	_
2收利息	7,456,477.25
/收股利	_
2收申购款	_
延所得税资产	_
(他资产	-
F产总计	514,326,867.74
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日
( 债:	
2期借飲	_
ど易性金融负债	_
f生金融负债	-
出回购金融资产款	223,999,480.00
2付证券清算款	-
2付赎回款	-
2付管理人报酬	171,585.71
2付托管费	49,024.50
2付销售服务费	107,805.50
2付交易费用	12,089.43
2交税费	191,416.88
Z付利息	356,687.22
2付利润	_
能延所得税负债	-
(他负债	82,500.00
(债合计	224,970,589.24
行者权益:	
以基金	280,020,032.95
:分配利润	9,336,245.55
有者权益合计	289,356,278.50
(债和所有者权益总计	514,326,867.74
年8月6日至2018年	E效日为2018年8月6日,2018年实际报告期 E12月31日。截至报告期末本基金合同生效; 及表及报表附注均无同期对比数据。

	单位:人民
項目	本期2018年08月06日(基金合同生效日)至2018年12月31日
一、收入	12,632,064.88
1.利息收入	7,936,800.51
其中:存款利息收入	173,187.21
债券利息收人	6,906,931.63
资产支持证券利息收入	639,548.49
买人返售金融资产收人	217, 133.18
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,076,519.06
其中:股票投资收益	
基金投资收益	-
债券投资收益	970,819.11
资产支持证券投资收益	105,699.95
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
投利收益	-
3公允价值变动收益(损失以"-"号 填列)	3,618,745.31
1.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-
喊:二、费用	3,295,819.33
1. 管理人报酬	800,973.17
2. 托管费	228,849.50
3. 销售服务费	107,809.73
1. 交易费用	7,394.56
5. 利息支出	2,039,833.38
其中:卖出回购金融资产支出	2,039,833.38
6. 税金及附加	25,358.99
7. 其他费用	85,600.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填 列)	9,336,245.55
域:所得税费用	_

值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月 为2018年8月6日至2018年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未

满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。 7.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体: 浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金 本报告期:2018年08月06日(基金合同生效日)至2018年12月31

項目	本期 2018年08月06日 (基金合同生效日 )至2018年12月31日					
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计			
一、期初所有者权益(基金净值)	280,020,032.95	-	280,020,032.95			
二、本期经营活动产生的基金净值变 动数(本期利润)	-	9,336,245.55	9,336,245.55			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-			
其中:1.基金申购款	-	-	-			
2.基金赎回款	-	-	-			
四、本期向基金份额持有人分配利润 产生的基金净值变动 (净值减少以 "-"号填列)	-	-	-			
五、期末所有者权益(基金净值)	280,020,032.95	9,336,245.55	289,356,278.50			

(注:) 本等业器业品问法及日分2016年6月6日 表2016年3時16日至2018年3月6日至2018年12月31日,截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署

7.4 报表附注 7.4.1 基金基本情况

/4.1 基亚基本情况 浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金(简称"本基金")经 中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")(证监许可[2017] 900号)《关于准予浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金注 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《浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金法》和《浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》向社会公开发行募集。《浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2018年8月6日正式生效,基金合同生效 券型证券投资基金基金合同》于2018年8月6日止工至級,基金合同已至级 目的基金份额总额为280,020,032,95份基金份额,其中浙商汇金聚禄 一年定期A基金份额总额214,021,509,23份,浙商汇金聚禄一年定期C 基金份额总额65,998,523.72份,相关募集业经北京兴华会计师事务所 [2018]京会兴浙分验字第6800016号验资报告予以验证。本基金为契 约型开放式基金、存续期限不定。基金管理人为浙江浙商证券资

57至扩放八器並,行後的於不定。釜並且是人分的几面同並分成戶目程 有限公司,注册登记机构为浙江游商证券资产管理有限公司,基金托管 人为中国光大银行股份有限公司。 7.4.2 会计报表的编制基础 本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》 以及其后颁布及修订的具体会计准则,应用指南,解释以及其伯相关规定(统称"企业会计准则")并参照《证券投资基金会计核算业务指引》及 《浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定而

mile 本财务报表以持续经营为基础列报。 74.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明 本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 于 2018年12 月31 日的财务状况以及 2018年度的经营成果和净值变

7.4.4 重要会计政策和会计估计 7.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制。即自每年1月1日至12月31日为一个会计年 度。本报告会计期间为2018年8月6日(基金合同生效日)至2018年12月 31日止。 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

74.43 金融资产和金融负债的分类 (1) 金融资产的分类 金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期 短触女/广丁秋原明人的ガデスパ になってい に ユニススタが ハスコッ 損益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融 资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现 无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。 本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量日 本基金とは「大きなどのである。

本籍或目前以父勿目印777日70以示汉以乃炎为公公公归 1847 当年 其变动计人均期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产 负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计 人损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。 本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买人

返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有 股份、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。 (2)金融负债的分类 金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

制量性效厂负债%公司的。公允允同量上基支动计入当务员量的基础资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允

从于以公元的旧时重日县吴幼时入当纳坝益的壶融资产,按照公元价值进行后读计量。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利线比;(2)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;或者(3)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。金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计人当期

。 当全融负债的现时义条全部动部分口经解除时 终止确认该全融负 债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的 差额,计入当期损益。 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、衍生工具等金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:
(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公 (1) 计正信部门地的显示性上级这类目录自己的一种,但是是一个人的信息,但是正交易目后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交

好及行机例本及生影响证券订恰的里入事件的, 按板近交易日的用场交易价格确定公允价值。 (2) 存在活跃市场的金融工具, 如估值日无交易且最近交易日后经 济环境发生了重大变化、参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。 (3) 当金融工具不存在活跃市场、采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技

术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的 价格。参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现 法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销 本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的

净额在资产负债表中列示。 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。由于申购和赎回引起的实收基金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。 的对人猛运的关权基立自加州中口基立的关权基立领之。 7448 损益平准金 损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在

申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金 期末全额转入未分配利润/(累计亏损) 7449 收入/(损失)的确认和计量 (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额人

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计 算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认, 在债券实际持有期内逐日计提; (3) 买人返售金融资产收人,接买人返售金融资产的摊余成本及实 际利率当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在证券

回购期内逐日计提:

回购别内及口口症; (4) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额人账; (5) 债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认,并按成交总额与

其成本、应收利息的差额入账 (6) 基金投资收益/(损失)于卖出基金成交日确认,并按卖出基金成交金额与其成本的差额人账; (7) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计

当期损益的利得或损失; (9) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能 流入且金额可以可靠计量的时候确认。 7.4.4.10 费用的确认和计量 本基金的管理人报酬和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。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入 当期费用。 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配; 2.本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利用投资,投资者可 选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不

选择。本基金默认的收益分配方式是现金分红; 3、基金收益分配后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 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。

7.45 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 7.45.1 会计政策变更的说明 7.45.1 会计政策变更的说明 本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。 7.45.2 会计估计变更的说明 

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]36号《关于进一步明确全面推开营业增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]26号《关于资管产品增值税政策有关问题的利务通知》、财税[2017]26号《关于资管产品增值税有货有规的通知》、财税[2017]26号《关于资管产品增值税有货有规的通知》、财税[2017]26号《关于资管产品增值税方统有关问题的通知》、财税[2017]26号《关于资管产品增值税方统有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:
(1)资管产品营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税的成分为,未缴纳增值税的,不再缴纳。日缴纳增值税的,不再缴纳增值税的,不再缴纳增值税的,不再缴纳增值税的,不再缴纳增值税的,不再缴纳增值税的,不再缴纳增值税的,不再缴纳增值税的,不再缴纳增值税的,不再缴纳增值税的,是约税额从资管产品管理人以后月 根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干

分的增值税应纳税额中抵减 77117年屆600至的於總平1504歲。 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资

管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生 的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017年12月31日前取得的基金、非货物期货、可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货、均均价价,以多少时间,以1011年最后,1011年,101

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收 ,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业 所得税。 (3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金

(3)为基金联件的近型倾众外围等水入,应由成11股次时以近增加上增量数 支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息 红利所得,持股期限在1个月以内含1个月的,其股息红利所得全额计 人应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计 人应纳税所得额;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、红利收人继续暂藏按50%计人应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不 征收股票交易印花税。 (6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 关联方关系

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。 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易 7.4.8.1.1 股票交易 本基金本报告期内无诵讨关联方交易单元讲行的股票交易。本基金

全国主义日本2018年8月6日,无上年度同期对比数据。 7.4.8.1.2 权证交易 本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。本基金 合同生效日未2018年8月6日,无上年度同期对比数据

单位:人民币元 本期 2018年08月06日 (基金合同生效日 )至2018年12月31日 注:本基金合同生效日为2018年8月6日,可比期间不完整,无同期

对比数据。 7.4.8.1.4 债券回购交易 单位:人民币元 本期 2018年08月06日(基金合同生效日)至2018年12月31日

对比数据。 7.4.8.15 应支付关联方的佣金 本基金合同生效日为2018年8月6日,可比期间不完整,无同期对比

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金,本报告期末无应付关 联方佣金余额。 7.4.8.2 关联方报酬 7.4.8.2.1 基金管理费 单位:人民币元

本期 2018年08月06日 (基金合同生效日 )至2018年12月31日 注:本基金合同生效日为2018年8月6日,可比期间不完整,无同期 对比数据。 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理 费的计算方法如下: H=E×0.7%-当年天数

H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值 基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理 人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-6个工作日 内从基金好产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,

支付日期顺延 7.4.8.2.2 基金托管费 本期 2018年08月06日 (基金合同生效日 )至2018年12月31日

注:本基金合同生效日为2018年8月6日,可比期间不完整 无同期 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

人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺

7.4.8.2.3 销售服务费

			业:人民中		
获得销售服务费的各关联方	本期 2018年08月06日 (基金合同生效日 )至2018年12月31日				
名称	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	浙商汇金聚禄一年定期A	浙商汇金聚禄一年定期C	合计		
光大银行	-	28,348.74	28,348.74		
浙商证券	-	73,554.23	73,554.23		
合计	-	101,902.97	101,902.97		
注: 本基金合同生	效日未2018年8月	6日, 无上年度同期	対比数据		

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务 明白版对战马州了华疆亚川动师、讯自尼汉建亚加强时代门版对等各项费用。本基金价物分为不同的美别,适用不同的销售服务费率。 中,A 类基金价额不收取销售服务费、C 类基金价额销售服务费年费率为 0.4%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算公式如下: H=E×0.4%。+当年天数

5。 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

H=E×0.4% - 当年天数 H为C类基金价额每日应计提的销售服务费 E为C类基金价额每日回的基金资产净值 销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理 人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5个工作 日内从基金财产中一次性划出,由基金管理人根据相关协议分别支付给 各基金销售机构。若遇法定节假日,公休日等,支付日期顺延。 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券合回购)交易 本担任即由土货生

本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交 本基金合同生效日为2018年8月6日,可比期间不完整,无同期对比

7.4.8.4.1 报告期内基金管理、运用固有资金投资本基金的情况 本基金的基金管理人在本报告期间内未运用固有资金投资本基金, 基金合同生效日为2018年8月6日。可比期间不完整、无同期对比数据。 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的 本报告期末未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况,本

华银石湖不水至上縣自星人之为的景區之歌力及瓦华盛立自然。 全同生效日为2018年8月6日,可比期间不完整,无同期对比数据。 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:(1) 本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行进行保管, 2)本基金合同生效日为2018年8月6日,可比期间不完整,无同期

7486 木基全在承销期内参与关联方承销证券的情况 本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况,本基金合同生效日为2018年8月6日,可比期间不完整,无同期对比数据。 74.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金未发生其他关联交易事项,基金合同生效日为2018年8月6 可比期间不完整,无同期对比数据。 7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期未持有的流通受限证券

截止本报告期末,本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

200,0 100,0 18 桂 投 交易所市场债券正

截止本报告期末,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的 山回购证券款,无抵押债券。 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

8.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

	序号	項目	金額	占基金总资产的比例(%)
	1	权益投资	-	-
		其中:股票	-	-
	2	基金投资	-	-
	3	固定收益投资	464,103,466.77	90.24
		其中:债券	423,908,018.00	82.42
		资产支持证券	40,195,448.77	7.82
	4	贵金属投资	-	-
	5	金融衍生品投资	-	-
	6	买人返售金融资产	30,010,135.02	5.83
		其中: 买断式回购的买人返售金融资产	-	-
	7	银行存款和结算备付金合计	12,728,985.12	2.47
	8	其他各项资产	7,484,280.83	1.46
	9	合计	514,326,867.74	100.00
类的	り境内	报告期末按行业分类的股 股票投资组合 :本报告期末,本基金未持		报告期末按行业分

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的股票。 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票 報24744 截止本报告期末,本基金未持有股票投资组合。 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 8.4.1 累计买人金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明

本基金本报告期内无股票交易。 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明

11.4 基金投资策略的改变 本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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。

本基金自基金合同成立以来一直聘请北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为42,500元。 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 报告期内基金管理人、托管人的业务部门及其高级管理人员未受稽

查或处罚等情况。 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况 金额单位:人民币元 成交金額 佣金

因作为证券公 他养商交易单元的资格,上海证券市场只能使用经公司浙南证券席位进行 行交易。截至报告期末,本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元 的资格,并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。本报告期 内,本报告期内本基金新增2个渐商证券交易单元

內,本报告期內本基金新增2个附商业券交易单元。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,包括旧不限于: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 公司所自在基础的特定多水,提供3个1加7元度,共有介及量化设员组合模型的能力;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

	债券	9交易	债券回购交易		权证交易		基金交易		
券商名称	成交金額	占当期债 券成交总 額的比例	成交金額	占当期债 券回购成 交总额的 比例	成交金額	占当期权 证成交总 額的比例	成交金額	占当期基 金成交总 额的比例	
浙商证券	454, 755, 210.09	100.00%	3,303, 100, 000.00	100.00%	-	-	-	-	
§ 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%的标									

12.2 影响投资者决策的其他重要信息 2019年1月,曾聘范旦被女士为浙商汇金聚禄一年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2019年2月,浙江浙商证券资产管理有限公司 聘任盛建龙先生担任总经理职务。上述人事变动,均已按相关规定备案

申购份

浙江浙商证券资产管理有限公司