浙商中证500指数增强型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:浙商基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2019年4月1日起至6月3日止。

§2 基金产品概况

转型后:

基金简称	浙商中证500增强	
交易代码	002076	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年4月24日	
报告期末基金份额总额	57,289,998.75份	
投资目标	本基金通过严格的投资程序约束和量化风险管理手段,在对标的指数有效跟踪的基础上,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.50%,年跟踪误差不超过8%。	
投资策略	本基金将运用指数化的投资方法,在控制组合跟踪误差基础上(年化跟踪误差4%~5%)调整成分股的权重,达到对标的指数的跟踪目标。 本基金主要依据新闻指数增强模型,在控制投资组合跟踪误差的基础上,对股票组合进行优化,力争获得超基准收益回报。	
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。	
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	浙商基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浙商中证500增强A	浙商中证500增强C
下属分级基金的交易代码	002076	007386
报告期末下属分级基金的份额总额	57,289,467.74份	531.01份

转型前:

基金简称	浙商灵活配置	
交易代码	000001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年5月11日	
报告期末基金份额总额	57,287,453.24份	
投资目标	本基金通过准确把握中国经济周期变动特征,挖掘不同经济周期阶段下优势资产及行业投资机会,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期,稳定增值。	
投资策略	本基金采用定量分析和定性分析相结合的方法,深入研究判国经济周期当前所处阶段(复苏、扩张、滞胀和衰退)及未来发展方向,确定不同经济周期阶段下的资产配置和行业投资策略,在有效控制风险的前提下,精选优质上市公司投票构建投资组合,力求获得较高的投资收益。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金为主动投资的混合型基金,其预期风险和收益高于债券型基金、货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。	
基金管理人	浙商基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月24日—2019年6月30日)	
	浙商中证500增强A	浙商中证500增强C
1.本期已实现收益	-3,918,937.91	-36,99
2.本期利润	-4,489,361.99	-26.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0784	-0.0539
4.期末基金资产净值	51,155,011.38	473.92
5.期末基金份额净值	0.8929	0.8925

3.1 主要财务指标(转型前)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日—2019年4月23日)
1.本期已实现收益	3,094,062.37
2.本期利润	791,992.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0138
4.期末基金资产净值	55,646,067.26
5.期末基金份额净值	0.9713

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 本报告期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

浙商中证500增强A

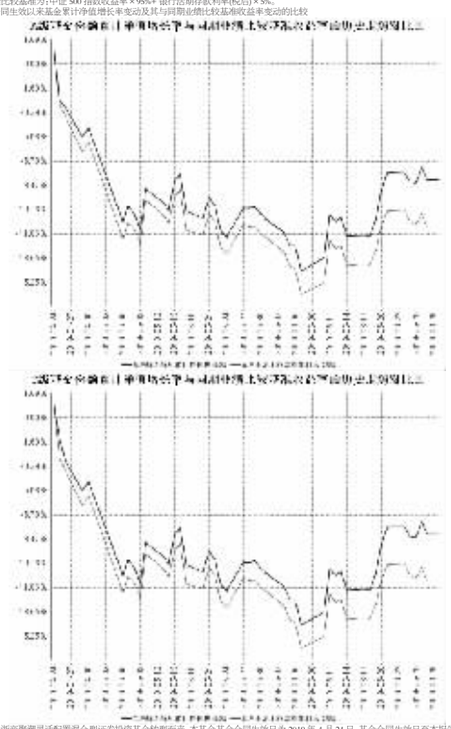
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.07%	1.77%	-11.44%	1.83%	3.37%	-0.06%

浙商中证500增强C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.11%	1.75%	-11.44%	1.83%	3.33%	-0.08%

注:本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金由浙商聚潮灵活配置混合型证券投资基金转型而来,本基金基金合同生效日为2019年4月24日,基金合同生效日至本报告期期末,本基金转型未满一年。
2.本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例应符合基金合同约定。

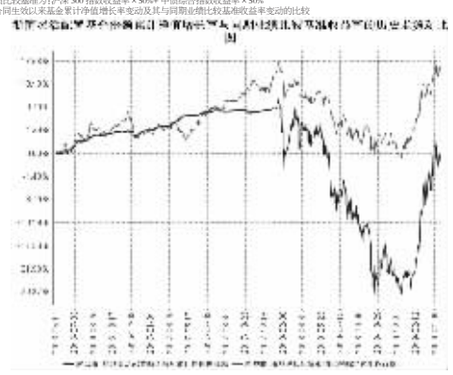
3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.44%	1.47%	1.41%	0.68%	0.03%	0.79%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金建仓期为6个月,从2016年5月11日至2016年11月10日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。
2.本基金建仓期为6个月,从2016年5月11日至2016年11月10日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介(转型前)

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周翰程	本基金的基金经理	2017年9月18日	-	8	周翰程先生,复旦大学经济学硕士。历任德邦证券股份有限公司债券交易员、债券研究员、债券投资经理。
袁晓磊	本基金的基金经理,公司智能投资部总经理	2018年1月12日	-	8	袁晓磊先生,香港中文大学财务学博士。历任博时基金管理有限公司投资策略及大宗商品分析师。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介(转型后)

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁晓磊	本基金的基金经理,公司智能投资部总经理	2018年1月12日	-	8	袁晓磊先生,香港中文大学财务学博士。历任博时基金管理有限公司投资策略及大宗商品分析师。
周翰程	本基金的基金经理	2017年9月18日	2019年5月31日	8	周翰程先生,复旦大学经济学硕士。历任德邦证券股份有限公司债券交易员、债券研究员、债券投资经理。

4.2 管理人对投资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》及其他相关法律法规、证监会规定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,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期,稳定增值。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了规范公平交易行为,保护投资者合法权益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规规定,本公司制定了相应的公平交易制度。在投资决策层面,本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,对不同类别的投资组合分别管理,独立决策;在交易层面,实行集中交易制度,建立了公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,严禁在不同投资组合之间进行利益输送;在监控和评估层面,本公司金融工程小组将每日审查当天的投资交易,对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控,同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内,本基金未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在报告期内,按照中证500指数增强策略操作。本基金通过投资约束和数量化控制,按照基金合同的要求,使用定量分析等技术,分析和应对导致基金跟踪误差的因素,积极应对市场的剧烈变化,努力将基金的跟踪误差控制在较低水平下,实现增强策略,达到产生相对基准超额收益的投资目的。报告期内,本基金持续优化指数跟踪策略,针对基金规模小、申购赎回对净值波动影响大的情况,尽力做了应对。二季度基金较好的完成了跟踪目标的同时,各类模型运行稳定,获得了一定幅度的超额收益。

宏观经济整体上仍可能走或低波动状态。增长还不具备快速复苏的条件,但向下具备了一定的韧性,短期内不太会又失速的风险。通胀则可能暂时度过了上升最快的时期,接下来的几个月可能在中高水平波动,下一个压力时期可能是在年底。货币流动性在6月份有所上升,但整个经济体的信用传导渠道仍然没有十分通畅,金融宽松的可能性也不大。外部环境仍然充满不确定性,汇率的波动压力继续存在。因此,综合来看,宏观经济的各个层面大体呈现出一个紧平衡的状态。对于市场,经过了一季度的快速上涨,二季度的回调,三季度大概率呈现震荡的格局,趋势性的拐点还不明确。目前股票市场的整体估值水平中低,长期的股票的相对吸引力仍占优于债券,这是决定股票配置中枢的主要因素。因此,股票配置的仓位水平不倾向于过低,应对前面所判断的有可能的市场大幅波动,更主要的是结构上调整与对冲。具体来看,价值和基本面因子的重要性继续提升,相比不断降低的债券收益率,股息率将变得更加宝贵。相关的组合,仍会持续向这几个维度偏离。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前,截至转型期末本基金份额净值为0.9713元,本报告期基金份额净值增长率为1.44%,业绩比较基准收益率为1.41%;转型后,截至本报告期末本基金A类份额净值为0.8929元,本报告期基金A类份额净值增长率为-8.07%,业绩比较基准收益率为-11.44%;截至本报告期末本基金C类份额净值为0.8925元,本报告期基金C类份额净值增长率为-8.11%,业绩比较基准收益率为-11.44%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

§5 投资组合报告

转型后:

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	47,937,644.37	93.19
	其中:股票	47,937,644.37	93.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,516,509.00	4.89
	其中:债券	2,516,509.00	4.89
	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	897,701.40	1.75
8	其他资产	87,036.34	0.17
9	合计	51,438,891.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	1,166,281.00	2.28
B	采矿业	853,858.42	1.67
C	制造业	23,631,690.96	46.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,255,345.45	2.45
E	建筑业	828,546.00	1.62
F	批发和零售业	2,275,499.10	4.45
G	交通运输、仓储和邮政业	1,579,721.00	3.09
H	住宿和餐饮业	226,712.64	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,166,324.21	10.10
J	金融业	1,612,034.60	3.15
K	房地产业	2,603,742.78	5.09
L	租赁和商务服务业	982,505.41	1.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	603,692.19	1.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	25,976.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	440,910.00	0.86
S	综合	1,066,559.00	2.08
	合计	44,319,398.76	86.64

5.2.2 报告期末积极投资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	39,227.88	0.08
B	采掘业	33,966.40	0.07
C	制造业	2,557,979.46	5.00
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	73,060.12	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,158.96	0.05
J	金融业	128,377.79	0.25
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	601,380.00	1.18
R	文化、体育和娱乐业	160,095.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	3,618,245.61	7.07

5.2.3 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002463	沪电股份	71,500	973,830.00	1.90
2	603369	今世缘	27,870	777,294.30	1.52
3	603228	景旺电子	19,160	766,591.60	1.50
4	000732	泰禾集团	44,600	735,900.00	1.44
5	000878	云南铜业	67,800	720,714.00	1.41
6	603806	福斯特	19,400	712,562.00	1.39
7	002399	海普瑞	33,700	707,363.00	1.38
8	601100	恒立液压	22,500	706,050.00	1.38
9	600282	南钢股份	201,300	704,550.00	1.38
10	600026	中远海能	107,800	699,622.00	1.37

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000596	古井贡酒	5,700	675,507.00	1.32
2	300146	汤臣倍健	33,000	640,200.00	1.25
3	300347	泰格医药	7,800	601,380.00	1.80
4	603658	安图生物	7,200	492,192.00	0.96
5	002563	森马服饰	18,100	200,186.00	0.39

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,516,509.00	4.92
	其中:政策性金融债	2,516,509.00	4.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,516,509.00	4.92

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	108603	国开1804	25,150	2,516,509.00	4.92

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受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没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,555.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	63,471.17
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,036.34

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明

注:本基金本报告期末不存在指数投资前十名股票流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.07	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

转型前:

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	51,703,029.11	92.47
	其中:股票	51,703,029.11	92.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,829,075.00	5.06
	其中:债券	2,829,075.00	5.06
	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	1,291,175.75	2.31
8	其他资产	92,213.36	0.16
9	合计	55,915,493.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	494,558.00	0.89
B	采矿业	2,259,944.03	4.06
C	制造业	27,904,279.42	50.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,575,685.30	2.83
E	建筑业	1,431,468.00	2.57
F	批发和零售业	2,376,358.00	4.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,923,690.80	3.46
H	住宿和餐饮业	296,836.85	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,226,551.80	9.39
J	金融业	2,276,949.65	4.09
K	房地产业	2,679,042.95	4.81
L	租赁和商务服务业	981,298.99	1.76
M	科学研究和技术服务业	83,574.40	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	389,868.92	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	373,824.00	0.67
R	文化、体育和娱乐业	1,186,668.00	2.13
S	综合	242,490.00	0.44
	合计	51,703,029.11	92.91

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600782	新钢股份	120,600	774,252.00	1.39
2	600008	首创股份	186,200	767,144.00	1.38
3	601717	郑煤机	119,924	754,321.96	1.36
4	002038	双鹭药业	26,300	714,045.00	1.28
5	601003	柳钢股份	87,100	641,927.00	1.15
6	600884	杉杉股份	41,200	624,592.00	1.12
7	600779	水井坊	12,700	589,280.00	1.06
8	002092	中泰化学	56,600	561,472.00	1.01
9	000975	银泰资源	52,203	529,338.42	0.95
10	600820	隧道股份	71,000	517,590.00	0.93

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,829,075.00	5.08
	其中:政策性金融债	2,829,075.00	5.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,829,075.00	5.08

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	108603	国开1804	28,150	2,829,075.00	5.08

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受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没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	32,399.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	56,409.28
5	应收申购款	3,404.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,213.36

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明

注:本基金本报告期末不存在前十名股票流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动(转型后)

单位:份

项目	浙商中证500增强A	浙商中证500增强C
基金合同生效日(2019年4月24日)基金份额总额	57,242,904.27	-
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	178,280.98	531.01
减:基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	131,717.51	-
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期末基金份额总额	57,289,467.74	531.01

§6 开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

报告期期初基金份额总额	57,288,140.29
报告期期间基金总申购份额	136,939.44
减:报告期期间基金总赎回份额	137,626.49
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	57,287,453.24

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况(转型后)

单位:份

基金合同生效日管理人持有的本基金份额	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

注:本基金本报告期无基金管理人持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型后)

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
合计			-	-	

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况(转型前)

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	-
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

注:本基金本报告期无基金管理人持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型前)

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
合计			-	-	

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401-20190630	49,999,000.00	0.00	0.00	49,999,000.00	87.27%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

(1)赎回申请延期办理的风险
机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险。
(2)基金净值大幅波动的风险
机构投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;
(3)提前终止基金合同的风险
机构投资者赎回后,可能出现基金资产净值低于5000万元的情形,若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人可能提前终止基金合同,基金财产将进行清算。
(4)基金规模过小导致的风险
机构投资者赎回后,可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

—

§9 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1.中国证监会批准浙商中证500指数增强型证券投资基金设立的相关文件;
2.《浙商中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》;
3.《浙商中证500指数增强型证券投资基金基金合同》;
4.《浙商中证500指数增强型证券投资基金托管协议》;
5.基金管理人业务资格批件和营业执照;
6.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;
7.中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

杭州市西湖区教工路18号世贸丽晶城欧美中心B座507室

10.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.zxfund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-067-9908/021-60359000查询相关信息。

浙商基金管理有限公司
2019年7月19日

浙商丰利增强债券型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:浙商基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浙商丰利增强债券
交易代码	006102
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年8月28日
报告期末基金份额总额	33,351,640.82份
投资目标	在严格控制组合风险的前提下,通过精选债券进行投资,并辅以适度的权益投资,力争实现基金资产的长期稳定投资回报。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,在科学分析与有效管理风险的基础上,实现风险与收益的最佳匹配。
业绩比较基准	中债总指数(全价)收益率×80%+沪深300指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中等预期风险/收益的产品。
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日—2019年6月30日)
1.本期已实现收益	-426,238.25
2.本期利润	-2,155,304.99
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0515
4.期末基金资产净值	33,243,750.58
5.期末基金份额净值	0.9968

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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